

海富通强化回报混合型证券投资基金更新招募说明书  
(2010年第1号)

**基金管理人：海富通基金管理有限公司**

**基金托管人：招商银行股份有限公司**

**重要提示**

海富通强化回报混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会2006年3月31日中国证券监督管理委员会证监基金字【2006】58号文件核准募集。本基金的基金合同于2006年5月25日正式生效。本基金类型为契约型开放式。

本招募说明书是对原《海富通强化回报混合型证券投资基金招募说明书》的定期更新，原招募说明书与本招募说明书不一致的，以本招募说明书为准。基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资有风险，投资者申购本基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本招募说明书所载内容截止日为2009年11月25日，有关财务数据和净值表现截止日为2009年9月30日。

本招募说明书所载的财务数据未经审计。

## 目录

第一节	绪言.....	2
第二节	释义.....	2
第三节	基金管理人.....	8
第四节	基金托管人.....	16
第五节	相关服务机构.....	22
第六节	基金的募集.....	35
第七节	基金合同的生效.....	37
第八节	基金份额的申购与赎回.....	38
第九节	基金的转换.....	45
第十节	基金的非交易过户与转托管.....	49
第十一节	基金的投资.....	50
第十二节	基金的业绩.....	63
第十三节	基金的财产.....	64
第十四节	基金资产的估值.....	65
第十五节	基金的收益与分配.....	70
第十六节	基金的费用和税收.....	72
第十七节	基金的会计与审计.....	73
第十八节	基金的信息披露.....	74
第十九节	风险揭示.....	78
第二十节	基金的终止和清算.....	80
第二十一节	基金合同的内容摘要.....	81
第二十二节	基金托管协议的内容摘要.....	96
第二十三节	对基金份额持有人的服务.....	109
第二十四节	其他披露事项.....	114
第二十五节	基金管理人和基金托管人的更换.....	117
第二十六节	招募说明书的存放及查阅方式.....	119
第二十七节	备查文件.....	119

## 第一节 绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）及其他有关规定以及《海富通强化回报混合型证券投资基金基金合同》编写。

本招募说明书阐述了海富通强化回报混合型证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的全部必要事项，投资人在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 第二节 释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 基金或本基金：**指海富通强化回报混合型证券投资基金；  
**基金合同或本基金合同：**指《海富通强化回报混合型证券投资基金基金合同》

- 及对本合同的任何有效修订和补充;
- 招募说明书:** 指《海富通强化回报混合型证券投资基金招募说明书》及其定期更新;
- 托管协议:** 指《海富通强化回报混合型证券投资基金托管协议》;
- 基金份额发售公告:** 指《海富通强化回报混合型证券投资基金基金份额发售公告》;
- 中国证监会:** 指中国证券监督管理委员会;
- 中国银监会:** 指中国银行业监督管理委员会;
- 银行业监督管理机构:** 指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会;
- 《证券法》:** 指《中华人民共和国证券法》;
- 《合同法》:** 指《中华人民共和国合同法》;
- 《基金法》:** 指《中华人民共和国证券投资基金法》;
- 《运作办法》:** 指自 2004 年 7 月 1 日起施行的《证券投资基金运作管理办法》;
- 《销售办法》:** 指自 2004 年 7 月 1 日起施行的《证券投资基金销售管理办法》;
- 《信息披露办法》:** 指自 2004 年 7 月 1 日起施行的《证券投资基金信息披露管理办法》;
- 《办理规则》:** 指上海证券交易所 2005 年 7 月 14 日发布并施行的《上海证券交易所开放式基金认购、申购、赎回业务办理规则（试行）》;
- 《实施细则》:** 指中国证券登记结算有限责任公司 2005 年 7 月 27 日发布并施行的《开放式基金通过上海证券交易所场内认购、申购与赎回登记结算业务实施细则》;
- 《操作指引》:** 指上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司 2005 年 7 月 27 日发布并施行的《通过上海证券交易所办理开放式基金相关业务操作指引》;
- 元:** 指人民币元;

- 基金合同当事人:** 指受本《基金合同》约束, 根据本《基金合同》享受权利并承担义务的法律主体, 包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人;
- 基金管理人:** 指海富通基金管理有限公司;
- 基金托管人:** 指招商银行股份有限公司;
- 注册登记业务:** 指本基金登记、存管、清算和交收业务, 具体内容  
包括投资人基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等;
- 注册登记人:** 指办理注册登记业务的机构。本基金的注册登记机构为海富通基金管理有限公司或接受海富通基金管理有限公司委托代为办理注册登记业务的机构。对于投资人通过销售机构提交的基金交易业务申请(包括基金认购、申购、赎回、转换、转托管、分红方式设置等), 其最终处理结果以注册登记机构的确认为准;
- 注册登记系统:** 指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金注册登记系统;
- 投资人:** 指个人投资人、机构投资人、合格境外机构投资人和法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者;
- 个人投资人:** 指依据中华人民共和国有关法律法规及其他有关规定可以投资于证券投资基金的自然人;
- 机构投资人:** 指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立和有效存续并依法可以投资证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其它组织;
- 合格境外机构投资者:** 指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内合法设立的证券投资基金的中国境外的机构投资

- 人;
- 基金份额持有人大会:** 指按照基金合同第九部分之规定召集、召开并由基金份额持有人进行表决的会议;
- 基金募集期:** 指基金合同和《招募说明书》中载明,并经中国证监会核准的基金份额募集期限,自基金份额发售之日起最长不超过三个月;
- 基金合同生效日:** 指基金募集期满,基金募集的基金份额总额超过核准的最低募集份额总额,并且基金份额持有人人数符合相关法律法规和基金合同规定的,基金管理人依据《基金法》向中国证监会办理备案手续后,中国证监会的书面确认之日;
- 基金合同终止日:** 指本基金合同规定的合同终止事由出现后按照本基金合同规定的程序终止基金合同的日期;
- 存续期:** 指本基金合同生效至终止之间的不定期期限;
- 认购:** 指在基金募集期内,投资人按照本基金合同的规定申请购买本基金基金份额的行为;
- 申购:** 指在本基金合同生效后的存续期间,投资人申请购买本基金基金份额的行为;
- 赎回:** 指基金份额持有人按本基金合同规定的条件,要求基金管理人购回本基金基金份额的行为;
- 巨额赎回:** 基金单个开放日,本基金净赎回申请(赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一日基金总份额的 10%时,即认为发生了巨额赎回;
- 基金转换:** 指基金份额持有人按基金管理人规定的条件,申请将其持有的基金管理人管理的某一基金(包括本基金)的基金份额转换为基金管理人管理的、由同一注册登记人办理注册登记的其他基金(包括本基金)

- 的基金份额的行为；
- 转托管：**指基金份额持有人将其基金账户内的某一基金份额从一个销售机构托管转移到另一销售机构的的行为；
- 投资指令：**指基金管理人在运用基金财产进行投资时，向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令；
- 会员单位：**指具有开放式基金代销资格，经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的、可通过上海证券交易所开放式基金销售系统办理开放式基金的认购、申购、赎回和转托管等业务的上海证券交易所会员；
- 代销机构：**指接受基金管理人委托代为办理本基金认购、申购、赎回和其他基金业务的具有基金代销业务资格的机构，以及可通过上海证券交易所开放式基金销售系统办理有关业务的会员单位；
- 销售机构：**指基金管理人直销机构及本基金代销机构；
- 场内或交易所：**指通过上海证券交易所交易系统办理基金份额认购、申购和赎回等业务的销售机构和场所；
- 场外或柜台：**指上海证券交易所开放式基金销售系统以外，办理开放式基金份额认购、申购、赎回等业务的销售机构和场所；
- 基金销售网点：**指基金管理人的直销中心及基金代销机构的代销网点；
- 指定媒体：**指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互联网网站；
- 基金账户：**指注册登记人为基金投资人开立的记录其持有的由该注册登记人办理注册登记的基金份额余额及其变动情况的账户；
- 交易账户：**指销售机构为基金投资人开立的记录其持有的由该

- 销售机构办理认购、申购、赎回、转换及转托管等业务的基金份额余额及其变动情况的账户；
- 工作日：**指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日；
- 开放日：**指为投资人办理基金申购、赎回等业务的工作日；
- T 日：**指销售机构受理投资人申购、赎回或其他业务申请的日期；
- T + n 日：**指 T 日后（不包括 T 日）第 n 个工作日
- 基金收益：**指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息及其他合法收入；
- 基金资产总值：**指基金购买的各类证券、银行存款本息、应收申购款以及其他资产的价值总和；
- 基金资产净值：**指基金资产总值减去基金负债后的价值；
- 基金份额净值**指计算日基金资产净值除以计算日基金份额余额总数；
- 基金财产估值：**指计算评估基金财产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程；
- 指定媒体**指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网站及其他媒体；
- 法律法规：**指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、司法解释、地方法规、地方规章、部门规章及其他规范性文件以及对于该等法律法规的不时修改和补充；
- 不可抗力：**指无法预见、无法克服、无法避免的任何事件和因素，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律变化、突发停电或其他突发事件、证券交易场所非正常暂停或停止交易等。

## 第三节 基金管理人

### （一）基金管理人概况

名称：海富通基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36-37 层

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36-37 层

法定代表人：邵国有

成立时间：2003 年 4 月 18 日

电话：021-38650999

联系人：包瑾

注册资本：1.5 亿元

股权结构：海通证券股份有限公司 51%、富通基金管理公司 49%。

### （二）主要人员情况

邵国有先生，董事长，副教授。历任吉林大学校党委副书记、长春师范学院校党委书记、长春新世纪广场有限公司副董事长兼总经理、海通证券股份有限公司宣传培训中心总经理。2003 年至今任海富通基金管理有限公司董事长。

吉宇光先生，董事，硕士，高级经济师。历任交通银行北京分行办公室副主任、交通银行北京分行证券部经理、海通证券北京朗家园营业部总经理等职。1997 年至今任海通证券股份有限公司副总裁。

艾德加 (Stewart Edgar) 先生，董事，英国籍，学士。历任英国 Ivory & Sime 公共有限公司基金经理，美国 Fiduciary 国际信托公司研究部主任、高级副总裁，英国 HD 国际有限公司高级基金经理、董事，美国 F&C 管理公司高级基金经理、董事。1997 年至今任富通基金管理公司董事总经理。

田仁灿先生，董事、总经理，比利时籍，工商管理硕士。历任法国金融租赁 Euroequipment S.A. 公司总裁助理，富通银行区域经理、大中华地区主管，富通基金管理亚洲有限公司投资经理、业务发展部总经理、首席执行官。2003 年至今任海富通基金管理有限公司董事、总经理。

张文伟先生，董事、副总经理，硕士，高级经济师。历任交通银行郑州分行

铁道支行行长、紫荆山支行行长、私人金融处处长，海通证券办公室主任，海通证券投资银行总部副总经理。2003 年至今任海富通基金管理有限公司董事、副总经理。

董文标先生，独立董事，硕士。历任交通银行郑州分行党委书记、行长，中国民生银行党委委员、副行长，中国民生银行党委书记、行长，现任中国民生银行股份有限公司董事长、党委书记。

郑国汉先生，独立董事，经济学硕士和博士学位。历任美国佛罗里达州大学经济系副教授、香港科技大学经济系教授、香港科技大学商学院经济系教授及系主任和商学院副院长，现任商学院署理院长。

巴约特 (Marc Bayot) 先生，独立董事，比利时籍，布鲁塞尔大学工商管理硕士。布鲁塞尔大学经济学荣誉教授，EFAMA (欧洲基金和资产管理协会) 和比利时基金会名誉主席，INVESTPROTECT 公司 (布鲁塞尔) 董事总经理、Pionner 投资公司 (米兰，都柏林，卢森堡) 和 Degroof 资产管理 (布鲁塞尔) 独立董事、基金联合公会 (哥本哈根) 独立董事。

杨国平先生，独立董事、硕士，高级经济师。历任上海杨树浦煤气厂党委副书记、代书记，上海市公用事业管理局党办副主任，上海市出租汽车公司党委书记，现任上海大众交通 (集团) 股份有限公司董事长兼总经理、上海大众公用 (集团) 股份有限公司董事长。

李础前先生，监事长，经济学硕士，高级经济师。历任安徽省社联所属省新科技发展公司副总经理、海通证券计划财务部总经理、海通证券财务总监。

余毓繁先生，监事，英国籍，工商管理荣誉学士。历任比利时通用银行香港分行资金部司库、富通银行亚洲区环球金融市场业务主管、富通银行亚洲区商人银行董事总经理。现任富通银行亚洲区行政总裁。

奚万荣先生，监事，经济学硕士。中国注册会计师协会非执业会员。历任海南省建行秀英分行会计主管、海通证券股份有限公司监察稽核部稽核员。2003 年 4 月至今任海富通基金管理有限公司稽核经理，监察稽核总监。

章明女士，督察长，硕士。历任加拿大 BBCC Tech & Trade Int' l Inc 公司高级财务经理、加拿大 Future Electronics 公司产品专家，国信证券业务经理和副高级研究员，海通证券股份有限公司对外合作部经理。2003 年至今任海

富通基金管理有限公司督察长。

陈洪先生，副总经理兼投资总监，硕士。历任君安证券有限公司投资经理、广东发展银行深圳分行业务经理、富通基金管理亚洲有限公司基金经理。2003年4月至今任海富通基金管理有限公司投资总监兼海富通精选混合基金基金经理，2005年7月至2006年9月任海富通股票基金基金经理，2006年3月至9月任海富通收益增长混合基金基金经理，2006年5月起，任海富通基金管理有限公司副总经理，2007年2月至2007年8月任海富通风格优势股票基金基金经理，2007年4月至2007年8月任海富通精选贰号混合基金基金经理，2008年6月起任海富通中国海外股票（QDII）基金基金经理。

阎小庆先生，副总经理，硕士。历任中国人民银行上海分行经济师、富通银行欧洲管理实习生、法国东方汇理银行市场部市场经理、法国农业信贷银行上海华东区首席代表、富通基金管理公司上海代表处首席代表、海富通基金管理有限公司市场总监，2006年5月起，任海富通基金管理有限公司副总经理。

蒋征先生，工商管理硕士。历任中国保险信托投资公司业务经理，嘉实基金管理有限公司丰和证券投资基金基金经理助理，2003年1月至2004年4月任泰和证券投资基金基金经理，2004年8月至2006年5月任华夏基金管理有限公司华夏大盘精选证券投资基金基金经理，2005年12月至2006年5月任兴安证券投资基金基金经理。2006年6月加入海富通基金管理有限公司，2006年9月起任海富通强化回报混合基金基金经理，2007年1月至2009年1月任海富通股票基金基金经理，2007年10月起任股票组合管理部总监，2009年1月起兼任海富通收益增长混合基金基金经理。

邵佳民先生，硕士。历任海通证券公司固定收益部债券业务助理、债券销售主管、债券分析师、债券投资部经理。2003年4月任海富通基金管理有限公司固定收益分析师，2005年1月至2008年2月任海富通货币基金基金经理，2006年5月起任海富通强化回报混合基金基金经理，2007年10月起任固定收益组合管理部总监，2008年10月起兼任海富通稳健添利债券基金基金经理。

本基金的历任基金经理为郑拓，任职时间为2006年5月至2006年9月。

本基金采用投资决策委员会领导下的团队式投资管理模式。投资决策委员会常设委员有：田仁灿，总经理；陈洪，副总经理兼投资总监；蒋征，股票组合管

理部总监；郭杰，股票组合管理部总监；邵佳民，固定收益组合管理部总监；戴德舜，研究总监；杜晓海，定量及风险管理总监。投资决策委员会主席由总经理担任。讨论内容涉及特定基金的，则该基金经理出席会议。

上述人员之间不存在近亲属关系。

### **（三）基金管理人的职责**

1. 依法募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

2. 办理基金备案手续；

3. 对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4. 按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5. 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6. 编制半年度和年度基金报告；

7. 计算并公告基金资产净值、确定基金份额申购、赎回价格；

8. 办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9. 召集基金份额持有人大会；

10. 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

11. 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

12. 国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

### **（四）基金管理人的承诺**

1. 基金管理人将严格遵守基金合同，按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制全权处理本基金的投资。

2. 基金管理人不得从事违反《基金法》的行为，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

（1） 将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

（2） 不公平地对待其管理的不同基金财产；

（3） 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

（4） 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

- (5) 用基金资产承销证券;
- (6) 用基金资产向他人贷款或提供担保;
- (7) 用基金资产从事无限责任的投资;
- (8) 用基金资产买卖其他基金份额,但国务院另有规定的除外;
- (9) 以基金资产向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;
- (10) 以基金资产买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券;
- (11) 用基金资产从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
- (12) 基金财产参与股票发行申购,所申报的金额超过基金的总资产,基金所申报的股票数量超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;
- (13) 本基金持有一家上市公司的股票,其市值超过本基金资产净值的10%;
- (14) 本基金与本基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券,超过该证券的10%;
- (15) 违反基金合同关于投资范围、投资策略和投资比例等约定;
- (16) 法律、法规、中国证监会及基金合同禁止的其他行为。

3. 基金管理人承诺加强人员管理,强化职业操守,督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范,诚实信用、勤勉尽责,不从事以下活动:

- (1) 越权或违规经营;
- (2) 违反基金合同或托管协议;
- (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益;
- (4) 在包括向中国证监会报送的资料中进行虚假信息披露;
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管;
- (6) 玩忽职守、滥用职权;
- (7) 泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的

基金投资内容、基金投资计划等信息；

- (8) 除按本公司制度进行基金运作投资外，直接或间接进行其他股票投资；协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；
- (9) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- (10) 贬损同行，以提高自己；
- (11) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (12) 以不正当手段谋求业务发展；
- (13) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (14) 法律法规禁止的其他行为。

#### 4. 基金经理承诺

- (1) 依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益。
- (2) 不利用职务之便为自己、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人谋取不当利益。
- (3) 不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息。
- (4) 不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

#### (五) 基金管理人的内部控制制度

##### 1. 内部控制的原则

本基金管理人的内部控制遵循以下原则：

(1) 全面性原则：内部控制必须覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节，并普遍适用于公司每一位员工；

(2) 独立性原则：公司根据业务发展的需要设立相对独立的机构、部门和岗位，并在相关部门建立防火墙；公司设立独立的风险管理部和监察稽核部，保持高度的独立性和权威性，分别履行风险管理和合规监察职责，并协助和配合督察长负责对公司各项内部控制工作进行稽核和检查；

(3) 审慎性原则：内部控制的核心是有效防范各种风险，任何制度的建立

都要以防范风险、审慎经营为出发点；

(4) 有效性原则：公司内部管理制度具有高度的权威性，是所有员工严格遵守的行动指南。执行内部控制制度不能有任何例外，任何人不得拥有超越制度或违反规章的权力；

(5) 及时性原则：内部控制制度的建立应与现代科技的应用相结合，充分利用电脑网络，建立电脑预警系统，保证监控的及时性；

(6) 适时性原则：内部控制制度的制订应具有前瞻性，并且必须随着公司经营战略、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策等外部环境的改变及时进行相应的修改和完善；

(7) 定量与定性相结合的原则：建立完备内部控制指标体系，使内部控制更具客观性和操作性。

(8) 成本效益原则：公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

(9) 相互制约原则：公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

## 2. 内部控制制度

公司严格按照《基金法》及其配套法规、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》等相关法律法规的规定，按照合法合规性、全面性、审慎性、适时性原则，建立健全内部控制制度。公司内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度和部门业务规章等三部分有机组成。

(1) 公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，是公司各项基本管理制度的纲要和总揽，内部控制大纲对内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容加以明确。

(2) 公司基本管理制度包括风险管理制度、合规性制度、稽核监察制度、投资管理制度、基金会计核算制度、信息披露制度、信息技术管理制度、公司财务制度、资料档案管理制度、人力资源管理制度和紧急应变制度等。公司基本管理制度的制定和实施需事先报经公司董事会批准。

(3) 部门业务规章是在公司基本管理制度的基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、岗位职责、业务流程和操作守则等的具体说明。部门业务规章由公司相关部门依据公司章程和基本管理制度，并结合部门职责和业务运作的要求拟

定，其制定和实施需事先报经公司业务管理委员会讨论通过和总经理批准。

公司致力于将国际资产管理行业成熟的专业经验同中国资产管理行业的实际情况相结合，建立既符合国际规范又行之有效的内部控制机制。

### 3. 完备严密的内部控制体系

公司建立独立的内部控制体系，董事会层面设立督察长，管理层设立独立于其他业务部门的监察稽核部和风险管理部，通过风险管理制度、合规性制度和稽核监察制度三个层面构建独立、完整、相互制约、关注成本效益的内部监督体系，对公司内部控制和风险管理制度及其执行情况进行持续的监督和反馈，保障公司内部控制机制的严格落实。

风险管理制度由董事会下设的风险委员会制定风险管理政策，由管理层的风险管理委员会负责实施，由风险管理部专职落实和监督，公司各业务部门制定审慎的作业流程和风险管理措施，全面把握风险点，将风险管理责任落实到人，实现对风险的日常管理和过程中管理，防范、化解和控制公司所面临的、潜在的和已经发生的各种风险。

合规性制度由监察稽核部具体落实，通过对公司日常业务的各个方面和各个环节的合法合规性进行评估及检查，监督公司及员工遵守国家相关法律法规、监管规定、公司对外承诺性文件和内部管理制度的情况，识别、防范和及时杜绝公司内部管理及基金运作中的各种违规风险，提出并完善公司各项合规性制度，以充分维护公司客户的合法权益。

稽核监察制度在督察长的领导下严格实施，由监察稽核部协助和配合督察长履行稽核监察职能，通过检查公司内部管理制度、资讯管制、投资决策与执行、基金营销、公司财务与投资管理、基金会计、信息披露、行政管理、电脑系统等公司所有部门和工作环节，对公司自身经营、资产管理和内部管理制度等的合法性、合规性、合理性和有效性进行监督、评价、报告和建议，从而保护公司客户和公司股东的合法权益。

### 4. 基金管理人关于内部控制的声明

本公司确知建立内部控制系统、维持其有效性以及有效执行内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任，董事会承担最终责任；本公司特别声明以上关于内部控制和风险管理的披露真实、准确，并承诺根据市场的变化和公司的发展不

断完善风险管理和内部控制制度。

## 第四节 基金托管人

### （一）基金托管人概况

#### 1、基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

设立日期：1987年4月8日

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

注册资本：147.07亿元

法定代表人：秦晓

行长：马蔚华

资产托管业务批准文号：中国证监会证监基字【2002】83号

电话：0755—83199084

传真：0755—83195201

资产托管部信息披露负责人：张燕

#### 2、发展概况

招商银行成立于1987年4月8日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于2002年3月成功地发行了15亿A股，4月9日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿H股，9月22日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），10月5日行使H股超额配售，共发行了24.2亿H股。截止2009年6月30日，招商银行总资产1.973万亿元人民币，核心资本824.66亿元人民币。

### （二）主要人员情况

秦晓先生，招商银行董事长和非执行董事，2001年4月加入本公司。英国剑桥大学经济学博士学位，高级经济师。第十一届全国政协委员，香港中国企业协会名誉会长、清华大学经济管理学院和中国人民银行研究生部兼职教授。

2001年1月起任招商局集团有限公司董事长。曾任中国国际信托投资公司总经理、副董事长、中信实业银行董事长。秦晓博士曾任第九届全国人大代表、国家外汇管理局外汇政策顾问、日本丰田公司国际咨询委员会委员，并于2001年担任亚太经合组织工商咨询理事会主席。

马蔚华先生，招商银行执行董事、行长兼首席执行官，1999年1月加入本公司。经济学博士学位，高级经济师。第十一届全国政协委员。1999年1月起任招商银行股份有限公司行长兼首席执行官。分别自1999年9月、2003年9月、2007年11月及2008年10月起兼任招银国际金融有限公司董事长、招商信诺人寿保险有限公司董事长及招商基金管理有限公司董事长及永隆银行有限公司董事长，并自2002年7月起担任招商局集团公司董事。同时担任中国国际商会副主席、中国企业家协会执行副会长、中国金融学会常务理事、中国红十字会第八届理事会常务理事、深圳市综研软科学发展基金会理事长和北京大学、清华大学等多所高校兼职教授等职。

唐志宏先生，招商银行副行长，吉林大学本科毕业，高级经济师。1995年5月加入本公司，历任沈阳分行副行长，深圳管理部副主任，兰州分行行长，上海分行行长，深圳管理部主任，总行行长助理，2006年4月起担任本公司副行长。同时担任招商信诺人寿保险公司及中国银联股份有限公司董事。

夏博辉先生，男，1963年11月出生，湖南人，管理学博士（厦门大学）、教授、注册会计师。现任招商银行资产托管部总经理，财政部会计准则咨询专家、金融会计组负责人，中国会计学会理事、中国金融会计学会专家委员会委员。1992-1999年历任湖南财经学院会计系副主任、科研处副处长、科研研究生处长、科研处处长及讲师、副教授、教授，2000-2005年6月历任深圳发展银行会计出纳部总经理、财务会计部总经理、计划财会部总经理、财务执行总监等职；2005年7月，加盟招商银行。1993-1996年，受聘担任世界银行技术援助中国人民银行会计改革体系项目金融会计准则研究组中方工作组组长。曾获“全国优秀教师并授予全国优秀教师奖章”（1993）、湖南省普通高校优秀教学成果一等奖（1993）、湖南省第五届优秀社会科学成果（著作）二等奖（1999）、中国青年

科技论坛二等奖（1999）。

胡家伟先生，大学本科学历，现任招商银行资产托管部副总经理。30多年银行业务及管理工作经历，已获得基金从业资格。历任招商银行总行国际业务部副总经理、招商银行蛇口支行副行长、招商银行总行单证中心主任。曾任中国银行湖北省分行国际结算处副科长、副处长、中国银行十堰分行副行长、香港南洋商业银行押汇部高级经理、香港中银集团港澳管理处业务部高级经理等职务。

### （三）基金托管业务经营情况

截至2009年11月30日，招商银行股份有限公司托管了招商安泰系列证券投资基金（含招商安泰股票型投资基金、招商安泰平衡型证券投资基金和招商安泰债券投资基金），招商现金增值证券投资基金、中信经典配置证券投资基金、长城久泰中信标普300指数证券投资基金、中信现金优势货币市场基金、光大保德信货币市场证券投资基金、友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、光大保德信新增长股票型证券投资基金、富国天合稳健优选股票型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、德盛优势股票型证券投资基金、华富成长趋势股票型证券投资基金、光大保德信优势配置股票型证券投资基金、益民多利债券型证券投资基金、德盛红利股票证券投资基金、上证央企50交易型开放式指数基金及其它托管资产，托管资产为1867.96亿元人民币。

### （四）托管人的内部控制制度

#### 1、内部控制目标

确保托管业务严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念；形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制，防范和化解经营风险，确保托管业务的稳健运行和托管资产的安全完整；建立有利于查错防弊、堵塞漏洞、消除隐患，保证业务稳健运行的风险控制制度，确保托管业务信息真实、准确、完整、及时；确保内控机制、体制的不断改进和各项业务制度、流程的不断完善。

#### 2、内部控制组织结构

招商银行资产托管业务建立三级内控风险防范体系：

一级风险防范是在总行行长层面对风险进行预防和控制。招商银行实行董事会领导下的行长负责制，重大事项的决策经行长办公会讨论决定，行长室下设风险控制委员会、内部控制状况评审委员会、稽核监督管理委员会、信息规划委员会等机构。

二级风险防范是总行资产托管部在业务室、专业岗位设置时，必须遵循内部控制制衡原则，监督制衡的形式和方式视业务的风险程度决定。

总行资产托管部内设立稽核监察室，负责部门内部风险预防和控制。稽核监察室在总经理室直接领导下，独立于部门内其他业务室和托管分部，对各岗位、各业务室、各分部、各项业务中的风险控制情况实施监督。

三级风险防范是各业务室对自身业务风险进行自我防范和控制。业务室根据法律法规、监管规定、业务规则及本部门具体情况制定工作流程及风险控制措施。

### 3、内部控制原则

(1) 全面性原则。内部控制应覆盖各项业务过程和操作环节、覆盖所有室和岗位，并由全部人员参与。

(2) 审慎性原则。内部控制的核心是有效防范各种风险，托管组织体系的构成、内部管理制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点，应当体现“内控优先”的要求。

(3) 独立性原则。各室、各岗位职责应当保持相对独立，不同托管资产之间、托管资产和自有资产之间应当分离。内部控制的检查、评价部门应当独立于内部控制的建立和执行部门，稽核监察室应保持高度的独立性和权威性，负责对部门内部控制工作进行评价和检查。

(4) 有效性原则。内部控制应当符合国家法律法规和监管机关的规章，具有高度的权威性，成为所有员工严格遵守的行动指南；执行内部控制制度不能存在任何例外，部门任何员工不得拥有超越制度或违反规章的权力。

(5) 适时性原则。内部控制应随着托管业务经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相

应的修订和完善。

(6) 防火墙原则。核算、清算、稽核监察等相关部门，应当在制度上和人员上适当分离，办公网和业务网分离，部门业务网和全行业务网分离，以达到风险防范的目的。

#### 4、内部控制措施

(1) 完善的制度建设。招商银行资产托管部制定了《招商银行证券投资基金托管业务管理办法》、《招商银行托管业务内控管理办法》和《招商银行证券投资基金托管业务操作规程》等一系列规章制度，从资产托管业务操作流程、会计核算、岗位管理、档案管理、保密管理和信息管理等方面，保证资产托管业务科学化、制度化、规范化运作。为保障托管资产安全和托管业务正常运作，切实维护托管业务各当事人的利益，避免托管业务危机事件发生或确保危机事件发生后能够及时、准确、有效地处理，招商银行还制定了《招商银行托管业务危机事件应急处理办法》，并建立了灾难备份中心，各种业务数据能及时在灾难备份中心进行备份，确保灾难发生时，托管业务能迅速恢复和不间断运行。

(2) 经营风险控制。招商银行资产托管部托管项目审批、资金清算与会计核算双人双岗、大额资金专人跟踪、凭证管理、差错处理等一系列完整的操作规程，有效地控制业务运作过程中的风险

(3) 业务信息风险控制。招商银行资产托管部通过数据加密传输、业务信息启动异地自动备份功能、业务信息磁带备份并由专人签收保存等措施保证业务信息及数据传递的安全性。业务信息不得泄露，有关人员如需调用，须经总经理室审批，并做好调用登记。

(4) 客户资料风险控制。招商银行资产托管部对业务运作过程中形成的客户资料，视同会计资料保管。客户资料不得泄露，有关人员如需调用，须经总经理室成员审批，并做好调用登记。

(5) 信息技术系统风险控制。招商银行资产托管部对信息技术系统管理实行双人双岗双责、机房空间隔离并设置门禁管理、电脑密码设置及权限管理、业务网和办公网、与全行业务网双分离制度，与外部业务机构实行防火墙保护等，保证信息技术系统的安全。

(6) 人力资源控制。招商银行资产托管部通过建立良好的企业文化和员工

培训、激励机制、加强人力资源管理及建立人才梯队队伍及人才储备机制，有效的进行人力资源控制。

（五）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、《运作办法》等有关证券法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金管理人参与银行间债券市场、基金管理人选择存款银行、基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人对上述事项的监督与核查中发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述监督内容的约定和其他有关法律法规的规定，应及时以书面形式通知基金管理人进行整改，整改的时限应符合法规允许的投资比例调整期限。基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。在规定时间内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人的投资指令违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定，应当拒绝执行，立即通知基金管理人限期改正，如基金管理人未能在通知期限内纠正的，基金托管人应向中国证监会报告。

基金管理人应积极配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或就基金托管人的疑义进行解释或举证；对基金托管人按照法律法规、基金合同和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

## 第五节 相关服务机构

### (一) 基金份额发售机构

#### 1、直销机构

名称：海富通基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36-37 层

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36 层

法定代表人：邵国有

全国统一客户服务号码：40088-40099（免长途话费）

电话：021-38650797

传真：021-33830160

#### 2、代销机构

##### (1) 招商银行

地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：秦晓

电话：(0755) 82090060

客户服务电话：95555

联系人：刘薇

网址：[www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)

##### (2) 中国建设银行股份有限公司

地址：北京市西城区金融大街 25 号

法定代表人：郭树清

客户服务电话：95533

联系人：何奕

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

##### (3) 中国银行股份有限公司

地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：肖钢

电话：010-66596688

传真：010-66593777

客户服务电话：95566

联系人：王徽

网址：www.boc.cn

**(4) 中国工商银行股份有限公司**

地址：中国北京复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

客户服务电话：95588

传真：010-66107914

联系人：田耕

网址：www.icbc.com.cn

**(5) 中国农业银行**

地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：项俊波

客户服务电话：95599

传真：010-85109219

网址：www.abchina.com

**(6) 交通银行股份有限公司**

地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：蒋超良

客户服务电话：95559

电话：021 - 58781234

联系人：曹榕

网址：www.bankcomm.com

**(7) 深圳发展银行**

地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

法定代表人：法兰克纽曼 (Frank Neil Newman)

客户服务电话：95501

电话： 0755—82088888

联系人： 周勤

网址： [www.sdb.com.cn](http://www.sdb.com.cn)

**(8) 中国民生银行股份有限公司**

地址： 北京市东城区正义路4号

法定代表人： 经叔平

客户服务电话： 95568

电话： 010-58560666

联系人： 董云巍

网址： [www.cmbc.com.cn](http://www.cmbc.com.cn)

**(9) 广东发展银行股份有限公司**

注册地址： 广州市农林下路83号

法定代表人： 李若虹

电话： 020-38322542、38322974

联系人： 詹全鑫 张大奕

网址： [www.gdb.com.cn](http://www.gdb.com.cn)

**(10) 上海浦东发展银行股份有限公司**

地址： 上海市浦东新区浦东南路500号

法定代表人： 金运

客户服务电话： 95528

电话： 021-61616152, 61616153

联系人： 汤嘉惠、倪苏云

网址： [www.spdb.com.cn](http://www.spdb.com.cn)

**(11) 中信银行**

地址： 北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人： 陈小宪

客户服务电话： 95558

联系人： 李瑞

网址： [www.ecitic.com/bank](http://www.ecitic.com/bank)

**(12) 中国光大银行股份有限公司**

地址：北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦

法定代表人：王明权

客户服务电话：95595（全国）

电话：(010)68098778

联系人：李伟

网址：[www.cebbank.com](http://www.cebbank.com)

**(13) 浙商银行股份有限公司**

地址：中国杭州市庆春路288号

法定代表人：张达洋

客户服务电话：995105665

联系人：吴军阳

网址：[www.ecitic.com/bank](http://www.ecitic.com/bank)

**(14) 宁波银行股份有限公司**

地址：宁波市江东区中山东路294号

法定代表人：陆华裕

客户服务电话：96528

联系人：胡技勋

网址：[www.nbc.com.cn](http://www.nbc.com.cn)

**(15) 海通证券股份有限公司**

地址：上海市广东路689号海通证券大厦

法定代表人：王开国

客户服务电话：021-95553 或 4008888001

联系人：李笑鸣

网址：[www.htsec.com](http://www.htsec.com)

**(16) 中信证券股份有限公司**

地址：深圳市湖贝路1030号海龙王大厦

法定代表人：王东明

电话：010-84864818

联系人：陈忠

网址：[www.ecitic.com](http://www.ecitic.com)

(17) 国泰君安证券股份有限公司

地址：上海市浦东新区商城路 618 号

法定代表人：祝幼一

客户服务电话：021-962588、400-8888-666

联系人：韩星宇

网址：www.gtja.com

(18) 申银万国证券股份有限公司

地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：丁国荣

客户服务电话：962505

联系人：邓寒冰

网址：www.sywg.com.cn

(19) 中信建投证券有限责任公司

地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：张佑君

客户服务电话：400-8888-108

联系人：权唐

网址：www.csc108.com

(20) 招商证券股份有限公司

地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

法定代表人：官少林

客户服务电话：400-8888-111 或 95565

联系人：黄健

网址：www.newone.com.cn

(21) 兴业证券股份有限公司

地址：福建省福州市湖东路 99 号标力大厦

法定代表人：兰荣

客户服务电话：400-8888-123

联系人：谢高得

网址：www.xyzq.com.cn

(22) 华泰证券股份有限公司

地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

客户服务电话：400-8888-168

联系人：张小波

网址：www.htsc.com.cn

(23) 长江证券股份有限公司

地址：武汉市新华下路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

客户服务电话：4008-888-999 或 027-85808318

联系人：李良

网址：www.95579.com

(24) 广发证券股份有限公司

地址：广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼

法定代表人：王志伟

电话：020-87555888

联系人：肖中梅

网址：www.gf.com.cn

(25) 东方证券股份有限公司

地址：上海市浦东大道 720 号 20 楼

法定代表人：王益民

客户服务电话：95503、40088-88506

联系人：吴宇

网址：www.dfzq.com.cn

(26) 国信证券股份有限公司

地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦

法定代表人：何如

客户服务电话：800-810-8868

联系人：林建闽

网址: [www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

**(27) 中国银河证券股份有限公司**

地址: 北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人: 胡长生

客户服务电话: 4008-888-888

联系人: 李洋

网址: [www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

**(28) 平安证券有限责任公司**

地址: 深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦三楼

法定代表人: 杨宇翔

客户服务电话: 95511

联系人: 袁月

网址: [www.pa18.com](http://www.pa18.com)

**(29) 中信万通证券有限责任公司**

地址: 青岛市市南区东海路 28 号

法定代表人: 史浩民

客户服务电话: 0532-96577

联系人: 丁韶燕

网址: [www.zxwt.com.cn](http://www.zxwt.com.cn)

**(30) 光大证券有限责任公司**

地址: 上海市浦东新区浦东南路 528 号上海证券大厦南塔 15-16 楼

法定代表人: 徐浩明

客户服务电话: 10108998 各地营业部咨询电话

电话: 021-68768800

联系人: 刘晨

网址: [www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

**(31) 中银国际证券有限责任公司**

地址: 上海市浦东银城中路 200 号中银大厦 39 层

法定代表人: 平岳

客户服务电话：4006208888

联系人：张静 金坚

网址：[www.bocichina.com.cn](http://www.bocichina.com.cn)

**(32) 世纪证券有限责任公司**

地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 楼

法定代表人：卢长才

电话：0755-83199511

联系人：刘军辉、王飞

网址：[www.csc.com.cn](http://www.csc.com.cn)

**(33) 东北证券股份有限公司**

地址：长春市自由大路 1138 号

法定代表人：矫正中

客户服务电话：0431-85096709

联系人：潘锴

网址：[www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

**(34) 天相投资顾问有限公司**

地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座

法定代表人：林义相

客户服务电话：400-887-8827

联系人：李华

网址：[www.txsec.com](http://www.txsec.com)

**(35) 中信金通证券有限责任公司**

地址：浙江省杭州市中河南路 11 号万凯庭院商务楼 A 座

法定代表人：刘军

客户服务电话：0571-96598

联系人：俞会亮

网址：[www.bigsun.com.cn](http://www.bigsun.com.cn)

**(36) 国海证券有限责任公司**

地址：广西南宁市滨湖路 46 号

法定代表人：张雅峰

客户服务电话：96100（广西），4008888100（全国）

联系人：覃清芳

网址：[www.ghzq.com.cn](http://www.ghzq.com.cn)

**(37) 华泰联合证券有限责任公司**

地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 25、24、10 层

法定代表人：马昭明

客户服务电话：400-8888-555，0755-25125666

联系人：盛宗凌

网址：[www.lhzq.com](http://www.lhzq.com)

**(38) 财通证券有限责任公司**

地址：杭州市解放路 111 号财通证券

法定代表人：陈海晓

客户服务电话：0571-96336（上海地区 962336）

联系人：乔俊

网址：[www.ctsec.com](http://www.ctsec.com)

**(39) 恒泰证券股份有限公司**

地址：内蒙古呼和浩特市新城区东风路 111 号

法定代表人：刘汝军

电话：021-68405273

联系人：张同亮

网址：[www.cnht.com.cn](http://www.cnht.com.cn)

**(40) 瑞银证券有限责任公司**

地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层

法定代表人：刘弘

客户服务电话：400-887-8827

联系人：谢亚凡、韩晓光

网址：[www.ubssecurities.com](http://www.ubssecurities.com)

**(41) 江南证券有限责任公司**

地址：江西省南昌市抚河北路 291 号

法定代表人：姚江涛

电话：0791-6768763

联系人：余雅娜

网址：www.scstock.com

**(42) 国元证券股份有限公司**

地址：安徽省合肥市寿春路 179 号

法定代表人：凤良志

客户服务电话：0551-96888

联系人：朱广军

网址：www.gyzq.com.cn

**(43) 德邦证券有限责任公司**

住所：上海市福山路 500 号城建大厦 26 层

法定代表人：方加春

客户服务电话：4008888128

联系人：罗芳

网址：www.tebon.com.cn

**(44) 宏源证券股份有限公司**

公司注册地址：新疆乌鲁木齐市建设路 2 号

住所：上海市福山路 500 号城建大厦 26 层

法定代表人：汤世生

客户服务电话：010-62294600

联系人：李茂俊

网址：[www.hysec.com](http://www.hysec.com)

**(45) 第一创业证券有限责任公司**

地址：深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25 层

法定代表人：刘学民

客户服务电话：0755-25832523

联系人：王立洲

网址：[www.firstcapital.com.cn](http://www.firstcapital.com.cn)

**(46) 湘财证券有限责任公司**

地址：湖南省长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼

法定代表人：陈学荣

客户服务电话：400-888-1551

联系人：钟康鹭

网址：[www.xcsc.com](http://www.xcsc.com)

**(47) 安信证券股份有限公司**

地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

法定代表人：牛冠兴

客户服务电话：400-800-1001

联系人：陈剑虹

网址：[www.essence.com.cn](http://www.essence.com.cn)

**(48) 中国建银投资证券有限责任公司**

地址：深圳福田区益田路与福华三路交界处深圳国际商会中心 48-50 层

法定代表人：杨小阳

客户服务电话：400-600-8008

联系人：刘权

网址：[www.essence.com.cn](http://www.essence.com.cn)

**(49) 中国国际金融有限公司**

地址：北京建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：李剑阁

公司总机：010-65051166（北京）；021-58796226（上海）

联系人：易建军

网址：[www.cicc.com.cn](http://www.cicc.com.cn)

**(50) 中国民族证券有限责任公司**

地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6 层-9 层

法定代表人：赵大建

客户服务电话：400-889-5618

联系人：李薇

网址：[www.e5618.com](http://www.e5618.com)

**(51)** 华宝证券有限责任公司

地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 23 层

法定代表人：陈林

客户服务电话：4008209898

联系人：刘闻川

网址：[www.cnhbstock.com](http://www.cnhbstock.com)

**(52)** 信达证券股份有限公司

地址：北京市西城区三里河东路 5 号中商大厦 10 层

法定代表人：张志刚

客户服务电话：400-800-8899

联系人：唐静

网址：[www.cindasc.com](http://www.cindasc.com)

**(53)** 长城证券有限责任公司

地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人：黄耀华

客户服务电话：400666888

联系人：匡婷

网址：[www.cgws.com](http://www.cgws.com)

**(54)** 方正证券有限责任公司

地址：湖南长沙芙蓉中路 2 段华侨国际大厦 22-24 层

法定代表人：张志刚

客户服务电话：95571

联系人：彭博

网址：[www.foundersc.com](http://www.foundersc.com)

**(55)** 齐鲁证券股份有限公司

住所：山东省济南市经十路 128 号

法定代表人：李玮

客服电话：95538

联系人：孙豪志

网址：www.q1zq.com.cn

### 3、场内销售机构

具有开放式基金代销资格的、经中国结算登记结算有限责任公司认可的上海证券交易所会员可成为本基金的场内销售机构，相关信息同时通过上海证券交易所网站（www.sse.com.cn）登载。

基金管理人可以根据需要，增加其他符合要求的机构代理销售本基金，并按照相关规定及时公告。

#### （二） 注册登记人

名称： 中国证券登记结算有限责任公司

注册地址： 北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

法定代表人： 陈耀先

电话： 010-58598835

传真： 010-58598907

联系人： 任瑞新

#### （三） 出具法律意见书的律师事务所

名称： 北京市金杜律师事务所

注册地址： 北京市朝阳区东三环中路 39 号建外 SOHU A 座 31 层

负责人： 王玲

电话： 010-58785588

传真： 010-58785599

联系人： 宋萍萍

联系电话： 0755-82125533

经办律师： 靳庆军、宋萍萍

#### （四） 审计基金财产的会计师事务所

名称： 普华永道中天会计师事务所有限公司

注册地址： 上海市浦东新区东昌路 568 号

办公地址： 上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

法人代表：杨绍信

电话：021- 61238888

传真：021- 61238800

联系人：陈兆欣

经办注册会计师：汪棣 薛竞

## 第六节 基金的募集

### （一）基金募集的依据

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集。

基金募集申请于 2006 年 3 月 31 日经中国证监会证监基金字【2006】58 号文核准。

### （二）基金存续期间：不定期

### （三）基金类型：契约型开放式

### （四）募集方式：

本基金通过各销售机构的基金销售网点向投资人公开发售。

投资者可以通过场内、场外两种方式认购本基金；场内销售渠道为可通过上海证券交易所开放式基金销售系统办理相关业务的上海证券交易所会员单位；场外销售渠道是指通过上海证券交易所开放式基金销售系统之外的办理相关业务的本公司直销中心和代销机构（具体名单见基金份额发售公告）。

除法律法规另有规定外，任何与基金份额发售有关的当事人不得预留和提前发售基金份额。

**（五）募集期限：**本基金募集期限自本基金发售之日起不超过 3 个月。本基金的实际募集期限为 2006 年 4 月 10 日至 2006 年 5 月 19 日。

**（六）募集对象：**中华人民共和国境内的个人投资人和机构投资者（法律法规及其他有关规定禁止投资证券投资基金者除外），以及合格境外机构投资者。

**（七）募集场所：**本基金通过销售机构办理基金销售业务的网点公开发售。

**（八）基金的最高募集规模：**本基金不设最高募集规模。

### （九）基金的面值、计算公式及认购费

1. 基金份额面值：1.00 元人民币

2. 认购费

本基金认购费率不高于 1.2%，具体费率结构如下表。认购费用于本基金的市场推广、销售、注册登记等设立募集期间发生的各项费用。

业务类型	金 额	费率
认购	$M \geq 500$ 万	按笔收取，1000 元/笔
	$200 \text{ 万} \leq M < 500 \text{ 万}$	0.5%
	$100 \text{ 万} \leq M < 200 \text{ 万}$	0.8%
	$50 \text{ 万} \leq M < 100 \text{ 万}$	1.0%
	$M < 50$ 万	1.2%

3. 认购份额的计算

本基金采用前端收费模式，即在认购基金时缴纳认购费。

投资人多次认购本基金的，注册登记人根据单次认购金额确定每次认购所适用的费率。计算方法如下：

$$\text{认购费} = \text{认购金额} \times \text{认购费率} / (1 + \text{认购费率})$$

$$\text{认购份额} = (\text{认购金额} - \text{认购费} + \text{认购利息}) / \text{基金份额面值}$$

认购费按四舍五入方法，保留到小数点后两位。场内认购份额以去尾方式保留到整数位，不足一份基金份额部分的认购资金零头由交易所会员单位返还给投资人；场外认购份额以四舍五入方式保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

### （十）投资人对基金份额的认购

1. 认购时间：本基金向个人投资人、机构投资人和合格境外机构投资者同时发售，具体发售时间由基金管理人根据相关法律法规及本基金基金合同，在基金份额发售公告中确定并披露。

2. 投资人认购应提交的文件和办理的手续：

详见基金份额发售公告及销售机构发布的相关公告。

3. 认购的方法

投资人认购时间安排、投资人认购应提交的文件和办理的手续，由基金管理人根据相关法律法规及本基金基金合同，在基金份额发售公告中确定并披露。

#### 4. 认购确认

基金销售网点受理投资人的申请并不表示对该申请已经成功的确认，而仅代表销售网点确实收到了认购申请。申请是否有效应以基金注册与过户登记人的确认登记为准。投资人可在基金合同生效后到各销售网点查询最终成交确认情况和认购的份额。

#### (十一) 基金份额的认购和持有限制

1. 投资人认购前，需按销售机构规定的方式全额缴款。
2. 投资人在募集期内可以多次认购基金份额，但已申请的认购不允许撤销。
3. 场外单次认购的最低金额为 1000 元；场内单次认购的最低金额为 1000 元，最高金额为 99,999,900.00 元，且场内单次认购金额必须是 100 的整数倍。
4. 场内认购需遵守《上海证券交易所开放式基金认购、申购、赎回业务办理规则（试行）》及相关《实施细则》和《操作指引》的规定。

#### (十二) 募集资金利息的处理方式

认购资金在募集期产生的利息折算为基金份额，归投资人所有；其中：场外认购资金利息折算的基金份额保留至小数点后两位；场内认购资金利息折算的基金份额以去尾的方式保留到整数位，舍去的小数部分归基金资产。利息转份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。

基金募集期间募集的资金存入专门帐户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

## 第七节 基金合同的生效

### (一) 基金合同的生效

基金募集期限届满具备下列条件的，基金管理人应当自募集期限届满之日起十日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起十日内，向中国证监会提交验资报告，办理基金备案手续：

- 1、在募集期限内基金募集份额总额不少于两亿份，基金募集金额不少于两亿元人民币；
- 2、基金份额持有人的人数不少于两百人；

基金备案获中国证监会书面确认之日起，基金合同生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。

## **(二) 基金募集失败**

1. 基金募集期届满，未达到基金合同的生效条件，或基金募集期内发生不可抗力使基金合同无法生效，则基金募集失败。

2. 如基金募集失败，基金管理人应以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用，在基金募集期限届满后30日内退还投资人已缴纳的款项，并加计银行同期存款利息。

3. 基金募集失败，基金管理人及托管人不得请求报酬。

## **(三) 本基金的基金合同已于2006年5月25日正式生效。**

# **第八节 基金份额的申购与赎回**

## **(一) 申购与赎回办理的场所**

本基金的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的代销机构。

投资人应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金的申购与赎回。销售机构名单和联系方式见上述第五节第(一)条。

基金管理人可以根据情况增加或者减少代销机构，并另行公告。销售机构可以根据情况增加或者减少其销售城市、网点，并另行公告。

## **(二) 申购与赎回办理的时间**

1. 本基金已于2006年7月6日起开始办理包括日常申购、赎回在内的日常交易业务。

### **2. 开放日及开放时间**

本基金为投资人办理申购与赎回等基金业务的时间（即开放日）为上海证券交易所、深圳证券交易所的交易日。在开放日的具体业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所交易日的交易时间。

若出现新的证券交易市场或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日进行相应的调整并公告，同时报中国证监会备案。

3. 申购的开始时间

本基金自《基金合同》生效日后不超过三十个工作日开始办理申购。

4. 赎回的开始时间

本基金自《基金合同》生效日后不超过三个月的时间起开始办理赎回。

5. 在确定申购开始与赎回开始时间后，由基金管理人最迟于开始日前3个工作日在至少一种指定媒体上公告。

6. 基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的，其基金份额申购、赎回或转换价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

### **（三） 申购与赎回的原则**

1. “未知价”原则，即基金的申购、赎回价格以受理申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；

2. “金额申购、份额赎回”的原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3. 基金份额持有人赎回基金份额，注册登记系统遵循“先进先出”的原则，即对基金份额持有人在销售机构托管的份额进行赎回处理时，申购确认日期在先的基金份额先赎回，申购确认日期在后的基金份额后赎回，以确定赎回份额所适用的费率；

4. 当日的申购与赎回申请可以在当日交易结束时间前撤销，在当日的交易时间结束后不得撤销；

5. 场内申购需遵守《上海证券交易所开放式基金认购、申购、赎回业务办理规则（试行）》及其相关的业务细则和操作指引。

6. 基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但最迟须在新的原则实施三个工作日前在至少一种指定媒体予以公告。

### **（四） 申购与赎回的程序**

1、 申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的交易时间内提出申购或赎回的申请。

投资人在提交申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资人在

提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效而不予成交。

## 2、 申购和赎回申请的确认

T日规定时间受理的申请，正常情况下，本基金管理人在T+1日内为投资人对该交易的有效性进行确认，在T+2日后（包括该日）投资人可向销售机构或以销售机构规定的其他方式查询申购与赎回的成交情况。

## 3、 申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，基金管理人或基金管理人指定的代销机构将投资人已缴付的申购款项本金退还给投资人。

投资人赎回申请成功后，基金管理人应通过注册登记机构按规定向投资人支付赎回款项，赎回款项在自受理基金投资人有效赎回申请之日起不超过7个工作日内划往投资人账户。在发生巨额赎回时，赎回款项的支付办法按本基金合同有关规定处理。

## （五） 申购和赎回的数额和价格

### 1、 申购金额、赎回份额及余额的处理方式

（1） 场外单次申购的最低金额为1000元；场内单次申购的最低金额为1000元，最高金额为99,999,900.00元，且场内单次申购金额必须是100的整数倍。

（2） 基金份额持有人在销售机构赎回时，每次赎回申请不得低于1000份基金份额，且通过场内申请赎回的基金份额必须是整数份；基金份额持有人赎回时或赎回后将导致在销售机构(网点)保留的基金份额余额不足1000份的，需一并全部赎回。

（3） 基金份额持有人在单个销售机构处持有本基金的最低份额为1000份。基金份额持有人因赎回、转换等原因导致其基金账户内在该销售机构处剩余的基金份额低于1000时，注册登记系统可对该剩余的基金份额自动进行强制赎回处理。

（4） 基金管理人可根据市场情况，调整以上申购金额、赎回份额及最低持

有份额的数量限制，并于调整前三个工作日至少在一种中国证监会指定的媒体上刊登公告并报中国证监会备案。

## 2、 申购份额的计算

本基金采用前端收费模式，即在申购基金时缴纳申购费，投资人在同一天多次申购的，根据单次申购金额确定每次申购所适用的费率。计算方法如下：

$$\text{申购费} = \text{申购金额} \times \text{申购费率} / (1 + \text{申购费率})$$

$$\text{申购份额} = (\text{申购金额} - \text{申购费}) / \text{T日基金份额净值}$$

申购费以四舍五入方式保留到小数点后两位。场内申购份额以去尾方式保留到整数位，不足一份基金份额部分的申购资金零头由交易所会员单位返还给投资人；场外申购份额以四舍五入方式保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

## 3、 赎回金额的计算

投资人在赎回基金份额需缴纳一定的赎回费用。

$$\text{赎回金额} = \text{赎回份额} \times \text{T日基金份额净值}$$

$$\text{赎回费} = \text{赎回份额} \times \text{T日基金份额净值} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回金额} - \text{赎回费}$$

赎回费、赎回金额以四舍五入方式保留小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

## 4、 基金份额净值的计算公式

T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日公告。遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。计算公式为：

$$\text{T日基金份额净值} = \text{T日基金资产净值} / \text{T日基金份额的余额数量}$$

本基金份额净值的计算，保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入，由此产生的误差在基金财产中列支。

## （六） 申购与赎回的费用

1、本基金的申购费用由申购人承担，不列入基金资产，用于基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，赎回费总额的25%归基金财产，75%用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

2、根据基金合同的规定，本基金申购费率不超过 1.5%，赎回费率不超过 0.5%。

3、申购费率按照申购金额逐级递减，投资人在一天之内如果有多笔申购的，按单笔申购金额确定每笔申购所适用的费率并分别计算。实际执行的申购费率如下：

业务类型	金 额 (M)	费率
申购	$M \geq 500$ 万	按笔收取, 1000 元/笔
	$200 \text{ 万} \leq M < 500 \text{ 万}$	0.6%
	$100 \text{ 万} \leq M < 200 \text{ 万}$	1.0%
	$50 \text{ 万} \leq M < 100 \text{ 万}$	1.2%
	$M < 50$ 万	1.5%

4、赎回费率按照持有时间逐级递减。本基金赎回费率按持有期分档如下：

业务类型	连续持有期限	费率
赎回	1 年以下	0.5%
	1 年（含）以上，2 年以下	0.25%
	2 年（含）以上	0

5、在遵守法律法规及基金合同规定的前提下，基金管理人可根据市场情况制定基金促销计划。基金促销计划可以针对特定时间范围、特定地域范围、特定行业、特定职业等的投资人或以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）进行基金交易的投资人等定期或不定期地开展。在基金促销活动期间，基金管理人可以对促销活动范围内的投资人调低基金申购费率、赎回费率。

6、基金管理人可以在基金合同规定的费率限额内自行决定调整申购、赎回费率或收费方式，并最迟于新费率开始实施三个工作日前在至少一种指定媒体予以公告。

### （七） 申购与赎回的注册登记

1、经基金销售机构同意，基金投资人提出的申购和赎回申请，在基金管理人规定的时间之前可以撤销。

2、投资人申购基金成功后，基金注册登记人在 T+1 日为投资人增加权益并

办理注册登记手续，投资人自 T + 2 日起有权赎回该部分基金份额。

3、投资人赎回基金成功后，基金注册登记人在 T + 1 日为投资人扣除权益并办理相应的注册登记手续。

4、基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，但不得实质影响投资人的合法权益，并最迟于开始实施前三个工作日在至少一家中国证监会指定的媒体公告。

#### **(八) 拒绝或暂停申购的情形**

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

1. 不可抗力。
2. 证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
3. 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
4. 基金财产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益的情形。

5. 基金管理人认为有正当理由需要暂停接受基金申购申请的；

6. 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### **(九) 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形**

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1. 不可抗力。
2. 证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
3. 连续两个开放日发生巨额赎回。
4. 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
5. 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应在当日向中国证监会报告，已接受的赎回申

请，基金管理人应按时足额支付；如暂时不能足额支付，可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付，但不得超过正常支付时间 20 个工作日。投资人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并依法公告。

#### **(十) 巨额赎回的情形及处理方式**

##### **1. 巨额赎回的认定**

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

##### **2. 巨额赎回的处理方式**

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分顺延赎回。

(1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的赎回申请时，按正常赎回程序执行。

(2) 部分顺延赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额的 10% 的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；当日未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获赎回的部分申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以该下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

##### **3. 巨额赎回的公告**

当发生巨额赎回并顺延赎回时，基金管理人应立即向中国证监会备案，并在 2 日内通过指定媒体、基金管理人的公司网站或销售机构的网点刊登公告，说明有关处理方法。

连续 2 日以上(含本数)发生巨额赎回,如基金管理人认为有必要,可暂停接受基金的赎回申请;已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项,但不得超过正常支付时间 20 个工作日,并应当在指定媒体上进行公告。

#### **(十一) 暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告**

1. 发生上述暂停申购或赎回情况的,基金管理人当日应立即向中国证监会备案,并在规定期限内至少在一种指定媒体上刊登暂停公告。

2. 如发生暂停的时间为 1 日,第 2 个工作日基金管理人应在至少一种指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告,并公布最近 1 个开放日的基金份额净值。

3. 如发生暂停的时间超过 1 日但少于 2 周,暂停结束,基金重新开放申购或赎回时,基金管理人应提前 2 个工作日在至少一种指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告,并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。

4. 如发生暂停的时间超过 2 周,暂停期间,基金管理人应每 2 周至少刊登暂停公告 1 次。暂停结束,基金重新开放申购或赎回时,基金管理人应提前 2 个工作日在至少一种指定媒体上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告,并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。

## **第九节 基金的转换**

### **(一) 基金转换**

基金转换是指基金份额持有人按基金管理人规定的条件,申请将其持有的基金管理人管理的某一基金(包括本基金)的基金份额转换为基金管理人管理的、由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金的(包括本基金)基金份额的行为。

### **(二) 基金转换申请人的范围**

任何基金的持有人均可以按照《基金合同》的规定申请和办理基金转换。

### **(三) 基金转换受理场所**

基金转换将通过基金管理人的直销中心及代销机构的代销网点进行。

### **(四) 基金转换受理时间**

基金管理人自 2006 年 7 月 6 日开始推出基金的转换业务。

在确定基金转换开始时间后，由基金管理人最迟于该开始时间前 3 日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。办理基金转换的时间为上海证券交易所、深圳证券交易所交易日。若出现新的证券交易市场或交易所交易时间更改或其它原因，基金管理人将视情况进行相应的调整并公告。

### （五）基金转换费用

1、本基金与海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通股票证券投资基金、海富通风格优势股票型证券投资基金、海富通精选贰号混合型证券投资基金和海富通领先成长股票型证券投资基金间的转换

对于每个基金账户，在每个会计年度内（1月1日至12月31日），本基金与海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通股票证券投资基金、海富通风格优势股票型证券投资基金、海富通精选贰号混合型证券投资基金、海富通领先成长股票型证券投资基金之间的转换，按以下费率执行：

转换情况	适用费率	计入转出基金资产的比率
第一次转换	0.1%	0.025%
第二次转换起	0.3%	0.075%

2、本基金与海富通稳健添利债券型证券投资基金的转换

(1) 从本基金转换成海富通稳健添利债券型证券投资基金 C 类时，转换费率适用本基金的赎回费率；

(2) 暂不开通海富通稳健添利债券型证券投资基金 C 类转换到本基金。

(3) 暂不开通海富通稳健添利债券型证券投资基金 A 类与本基金之间的转换业务。

3、本基金与海富通货币市场证券投资基金的转换

(1) 从本基金转换成海富通货币市场证券投资基金时，转换费率适用本基金的赎回费率；

(2) 从海富通货币市场证券投资基金转换成本基金时，转换费率适用本基金的申购费率。

基金管理人可自行决定调低转换费率，并最迟于新费率开始实施前 3 个工作

日在至少一种指定媒体予以公告。

### (六) 基金转换公式

1、 基金的转换公式为：

$$A=[B \times C \times (1-D)+G] \div E$$

$$F= B \times C \times D$$

其中，

A 为转换入基金的基金份额数量；

B 为转换出基金的基金份额数量；

C 为转换日转换出基金的基金份额净值；

D 为转换费率；

E 为转换日转换入基金的基金份额净值；

F 为转换费

G 为转换出基金份额对应的未支付收益，若转换出基金为非货币市场基金的，则  $G = 0$ 。

转换费、转换入份额以四舍五入的方式保留至小数点后第 2 位。

例：假定投资人提出将所持有的海富通强化回报证券投资基金转换成海富通精选证券投资基金。

假定 T 日的两基金份额资产净值分别为 1.100 元和 1.200 元，转换份额为 100 万份，假设转换费率为 0.3%，那么转换申请所负担的转换费和相应的基金份额数等数值计算如下：

B 1,000,000

C 1.100

D 0.4%

E 1.200

F 3300

G 0

A 913,916.67

即该投资人所持有的海富通强化回报证券投资基金减少 100 万份，同时增持海富通精选证券投资基金 913,916.67 份，转换费为 3300 元。

2、基金管理人在不损害各基金持有人权益的情况下可更改上述公式，但应最迟在新的公式适用前 3 个工作日予以公告。

### **（七）基金转换的程序**

#### 1. 基金转换的申请方式

基金份额持有人必须根据基金管理人和基金代销机构规定的手续，在开放日的交易时间段内提出基金转换申请。

#### 2. 基金转换申请的确认

基金管理人应以收到基金转换申请的当天作为基金转换申请日（T 日），并在 T+1 工作日对该交易的有效性进行确认。投资者可在 T+2 工作日及之后到其提出基金转换申请的网点进行成交查询。

### **（八）基金转换的数额限制**

基金转换按照份额进行，申请转换份额精确到小数点后两位，单笔转换份额不得低于 1000 份。

### **（九）基金转换的注册登记**

1. 基金投资人提出的基金转换申请，在当日交易时间结束前可以撤销，交易时间结束后即不得撤销。

2. 基金份额持有人申请基金转换成功后，基金注册登记人在 T+1 工作日为基金份额持有人办理相关的注册登记手续。

3. 基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前 3 个工作日予以公告。

### **（十）拒绝或暂停基金转换的情形及处理方式**

1. 除非出现如下情形，基金管理人不得拒绝或暂停接受各基金份额持有人的基金转换申请：

a) 不可抗力；

b) 证券交易场所依法决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

c) 基金管理人认为可能有损于现有基金份额持有人利益的某笔转换申请；

d) 法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。如果基金份额持有人的基金转换申请被拒绝，基金份额持有人持有的原基金份额不变。

2. 发生上述情形之一的，基金管理人应在当日立即向中国证监会备案。

3. 发生《基金合同》或招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人有关正当理由认为需要拒绝或暂停接受基金转换申请的，应当报经中国证监会批准。

4. 暂停基金转换，基金管理人应立即在至少一种指定媒体上公告。

5. 暂停期结束，基金重新开放时，基金管理人应当公告最新的基金份额净值。

如果发生暂停的时间为 1 天，基金管理人应于重新开放日在至少一种指定媒体上刊登基金重新开放基金转换的公告，并公告最新的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过 1 天但少于两周，暂停结束，重新开放基金转换时，基金管理人应提前 1 个工作日在至少一种指定媒体刊登基金重新开放基金转换的公告，并在重新开放基金转换日公告最新的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过两个月时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束，重新开放基金转换时，基金管理人应提前 3 个工作日在至少一种指定媒体上连续刊登基金重新开放基金转换的公告，并在重新开放基金转换日公告最新的基金份额净值。

## 第十节 基金的非交易过户与转托管

（一）非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式，将一定数量的基金份额按照一定规则从某一投资人基金账户转移到另一投资人基金账户的行为，包括继承、捐赠、强制执行，及基金注册登记人认可的其它行为。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是合格的个人投资人或机构投资人。其中：

1. “继承”是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承。

2. “捐赠”仅指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或其他具有社会公益性质的社会团体。

3. “强制执行”是指国家有权机关依据生效的法律文书将基金份额持有人持有的基金份额强制执行划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。

(二) 办理非交易过户业务必须提供基金注册登记人要求提供的相关资料,对于符合条件的非交易过户申请自申请受理日起 2 个月内办理,并按基金注册登记机构规定的标准收费。

(三) 基金份额持有人在变更办理基金申购与赎回等业务的销售机构(网点)时,可办理已持有基金份额的转托管。

投资者申购基金份额后可以向原申购基金的销售机构发出转托管指令,缴纳转托管手续费,转托管完成后投资者才可以在转入的销售机构赎回其基金份额。转托管在转出方进行申报,基金份额转托管经一次申报便可完成。投资者于 T 日转托管基金份额成功后,转托管份额于 T+1 日到达转入方网点,投资者可于 T+2 日起赎回该部分基金份额。

(四) 基金注册登记人只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻。基金份额被冻结的,被冻结部分产生的权益(包括现金分红和红利再投资)一并冻结。

## 第十一节 基金的投资

### (一) 投资目标

每年超越三年期定期存款(税前)加权平均收益率。

### (二) 投资方向和范围

本基金投资范围限于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合的资产配置:股票资产 0%-95%,权证投资 0-3%,债券 5%-95%;本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他产品,基金管理人在履行适当的程序后,可以将其纳入投资范围。

### (三) 投资理念

综合运用灵活而有纪律的资产配置策略、精选证券策略和收益管理策略,实现投资目标。首先,有效并有纪律的灵活资产配置和精选证券是获得回报的主要来源。其次,收益管理和风险管理是保证回报的重要手段。

#### （四）投资策略

本基金认为，灵活而有纪律的资产配置策略和精选证券是获得回报的主要来源，而收益管理和风险管理是保证回报的重要手段。因此，本基金将运用资产配置、精选证券和收益管理三个层次的投资策略，实现基金的投资目标。

##### 1. 资产配置策略

资产配置策略以基金的投资目标为中心，在实现既定的投资目标同时将可能的损失最小化。因此，本基金将基于定量和定性相结合的宏观分析，形成对不同市场周期的预测和判断，通过灵活主动的又有纪律的资产配置，确定组合中股票、债券、货币市场工具和其他金融工具的投资比例，追求较高的收益，规避市场的系统性风险。

##### （1）宏观分析因素的主要内容：

- 经济周期和经济环境，包括宏观经济发展趋势，经济的景气周期研究等。本基金管理人将特别关注 GDP 增长、各种国民生产统计指标等，从而分析对股票市场的影响；

- 货币因素，主要包括利率水平及其变化、CPI、货币政策等。本基金管理人还将时刻关注利率以及人民币汇率水平的变化对中国经济及证券市场的影响；

- 市场估值，包括市场的相对定价水平、估值水平等。通过分析不同资产类别的长期风险收益特征，研究影响短中期各类资产估值的因素、市场出现的短期不均衡等情况，以定性定量的方法，侧重于研究证券市场的定价指标如 PE、债券收益率等，以及证券类资产与商品类资产如石油、黄金、房地产等价格趋势比较及其影响；

- 政策影响因素，不同政策发布对不同资产类别的影响分析等。本基金管理人相信政策对中国证券市场的影响将在相当长的一段时间内发挥非常重要的作用，因此我们将总结历史，密切关注及预测政策发生对证券市场产生的影响；

- 利润预测分析因素，通过对商品价格、货币价格变化的分析，形成对行业利润趋势的意见；

- 量化模型分析因素，通过市场价值中枢模型，从量化的角度衡量资产类别的估值水平，并发现市场趋势；

- 市场气氛，通过对不同技术指标以及信心等对证券市场的气氛进行评估。

通过对信心指标如分析师指数、市场特殊效应、人气指标、成交量指标、换手率指标进行分析，帮助基金确定和调整资产类别间的配置。

## （2）市场价值中枢评估模型（AVM）

市场价值中枢评估模型主要用来衡量证券市场定价水平，其核心思想是通过分析不同资产类别的长中期风险收益特征和相关性，发现市场未来趋势，并依据股票市场与其他市场投资产品的收益率来判断股票市场平均价格水平是否被高估的理论方法。

综上，如果结合量化模型分析与定性判断发现股票市场价值被高估，在资产配置决策中，将不再扩大或控制股票投资比例。如果股票市场价值高估程度较高，将选择降低股票持仓比例，实现收益。

## 2. 股票投资策略

本基金从投资目标出发，运用海富通 定价选股策略，选择稳定收益型、高安全边际型股票，作为基金持有的核心股票。同时，利用均值反转策略主动管理事件驱动型股票，把握有利的投资机会，追求收益的最大化。另外，还将运用IPO 或金融衍生工具等各种套利策略进行套利，提高基金收益水平。

### （1）海富通定价选股策略

海富通 定价选股策略运用海富通定价分析系统研究发掘具有稳定收益或具有高安全边际的兼具价值成长特征的核心资产和稳健资产型股票，主要有以下二类：

#### ● 稳定收益型

对于稳定收益型股票，本基金将以较高预期股息收益率为核心，同时结合以下几方面进行选择：

- 公司进入稳定发展阶段，预期主营业务收入及净利润保持稳定增长；
- 公司现金流状况良好；
- 公司有现金分红历史记录，同时具有继续进行现金分红的潜力；
- 预期股息收益率处于市场平均水平之上。

根据以上标准，选择出重点目标公司，在周密的案头研究基础上，通过实地调研，最终精选一批具备投资价值的收益型股票。

#### ● 高安全边际型

高安全边际型股票主要是指股票价格与价值之间的差异高过某一安全边际

的股票。本基金对于高安全边际股票投资价值的判断，主要依赖于两方面的基础工作：一是以行业专家和财务专家的角度对公司发展、经营和财务状况进行深入调查研究，二是运用 DDM、DCF 或 DFCF 等模型，选择股价具有较大升值空间的价值成长兼有型公司，主要包括两类：

一类是企业在过去经营中累积的核心竞争优势，包括由于公司具有强有力的管理团队、先进的技术、独占的专利、持续的创新能力和严格规范的管理、独到的企业文化、雄厚的品牌商誉、庞大的市场网络等因素带给企业持续发展的能力；

另一类是由于政策垄断、资源独占、进入壁垒高等因素所带给企业的持续发展能力，并且这些因素在可预见的将来不会改变或消失。

具有持续发展能力的上市公司一般具有以下特点：

- 公司主营业务清晰突出，经营业绩稳定成长，业绩真实、可靠；
- 财务状况良好，具备良好的盈利记录，有一定的现金分红能力；
- 有强有力的管理团队，重视股东价值增加，诚实信用；
- 公司在成本、技术、研究开发、市场营销、管理创新等方面具有一定优势，在行业内处于领先的地位，并且在竞争中积累了对手难以模仿的资源或能力；
- 公司股票具备一定规模的流通市值，具备良好的流动性。

本基金通过投资于具有高安全边际和持续发展能力的价值成长兼有的上市公司，可以在较长的时期分享中国经济增长的成果，获取资本的中长期平稳增长。

## （2）股票均值反转策略

股票均值反转策略主要用于具有价值回归潜能的股票。均值反转策略注重运用股价的均值反转规律，强调“先行价值发现、提前控制风险”，简单讲，就是在市场取得一致认识之前，超前发现和介入价值被低估的行业和个股，并在市场存在下跌风险时，通过资产配置比例的调整，提前控制下跌风险。例如，当公司经营过程中发生重大事件，基金管理人评估上市公司的投资价值，发掘可能存在的被低估的现象，把握比较有利的投资机会；或者，进行资产重组，基金管理人对上市公司进行深入的研究与调研，如上市公司的质地将发生显著变化，本基金管理人可以通过购入股票获取未来公司步入正轨后产生的高回报。运用均值反转策略所选的股票类型如下：

运用均值反转策略精选事件驱动型股票具有以下特征：

- 由某一重大事件造成股票价格非理性大幅下跌，而公司的基本面并未发

生实质性的变化；

- 由于经济、行业、市场周期，不符合某一时期市场热点，被投资者遗弃的行业或公司，特别是那些相对于近两、三年价格高点，股价处于相对低位的股票。

通过对其所处行业、公司基本面的分析，寻找价值未能被市场充分认识的股票作为投资对象，利用市场的均值反转规律，在其价值回归过程中获益。

### **(3) 套利策略**

套利策略主要是利用信息和研究股票市场间或不同股本类金融产品价格失衡带来的投资机会，以较低成本、较快的速度把握各种市场机会。主要包括：新股 IPO 套利策略、增发套利策略和 ETF 套利策略等。

### **(4) 衍生金融工具套利策略**

本基金的权证投资将以保值为主要投资策略，以充分利用权证来达到控制下跌风险、实现保值和锁定收益的目的；在个股层面上，充分发掘可能的套利机会，以达到增值的目的。

本基金可以持有在股权分置改革中被动获得的权证，并可以根据证券交易所的有关规定卖出该部分权证或行权。

本基金将根据权证投资策略主动投资于在股权分置改革中发行的权证。

随着我国权证市场的发展，在以后法律法规允许的情况下，本基金将运用认沽权证或认购权证控制风险，增加收益。

## **3. 债券投资策略**

本基金采用“总收益”管理方法来管理债券，债券投资的原则是为基金组合提供稳定收益和降低波动风险。

债券投资采取“自上而下”的策略，深入分析宏观经济、货币政策和利率变化趋势以及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以价值发现为基础，采取以久期管理策略为主，辅以收益率曲线策略、收益率利差策略等，确定和构造能够提供稳定收益、流动性较高的债券和货币市场工具组合。

另外，本基金在债券投资过程中将密切关注市场创新和变化中带来的投资机会，以及把握债券套利和可转债套利的投资机会，提高债券投资的收益水平。

- 债券套利策略(Fixed-income arbitrage)：通过分析收益率曲线变动趋势及不同债券品种的各种要素，挖掘因收益率曲线变动和不同固定收益市场、

品种和期限结构的利差变动而产生的套利机会。

- 可转债套利 (Convertible arbitrage): 由于可转债价格变动对于基础股票价格波动敏感性的非线性特征, 使得可转债具有上涨和下跌的不对称性。转债在基础股票上涨时候参与程度高, 下跌时候参与度小, 同时充分利用转股价格修正和回售条款等博弈条款产生的套利机会。

- 在市场创新和变化中寻找投资机会: 在新兴的中国债券市场, 存在广阔的产品创新空间和变化, 为基金提供了较为丰富的获利空间。

#### 4. 收益管理策略

根据投资目标, 本基金强调收益管理策略, 及时锁定已实现的收益和控制下跌风险, 将相对收益转化为实现收益。

本基金运用期间收益率 (PERIODIC RETURN) 和滚动收益率 (ROLLING RETURN) 等严格纪律的收益管理方法, 实现锁定收益和控制风险的目标。对于资产配置, 收益管理策略主要是根据定量定性分析, 在市场趋势发生变化时, 及时调整大类资产配置, 及时提高或降低风险类资产比重; 对于股票投资, 主要是策略性地持有股票, 而不片面强调中长线静态持有。本基金将根据对股票收益率动态变化的分析预测, 兼顾当时的市场趋势和个股的市场表现, 通过对股票价格与价值相对波动和偏离程度的分析来掌握买卖时机, 在股价的波动中适时实现收益或控制损失。另外, 在未来法律法规允许的情况下, 本基金将运用权证作为收益风险管理工具, 有效的控制下跌风险和锁定已实现利润, 将相对收益转化为实现收益, 实现基金净值的增长。

### (五) 投资决策

#### 1、决策依据

- (1) 投资决策须符合有关法律、法规和基金合同的规定;
- (2) 投资决策是根据本基金产品的特征决定不同风险资产的配比;
- (3) 投资部策略分析师、股票分析师、固定收益分析师、定量分析师各自独立完成相应的研究报告, 为投资策略提供依据。

#### 2、决策程序

本基金采用投资决策委员会领导下的团队式投资管理模式。投资决策委员会不定期就投资管理业务的重大问题进行讨论。基金经理、分析师、交易员在投资

管理过程中既密切合作，又责任明确，在各自职责内按照业务程序独立工作并合理地相互制衡。具体的决策流程如下：

(1) 投资决策委员会依据国家有关基金投资方面的法律和行业管理法规，决定公司针对市场环境重大变化所采取的对策；决定投资决策程序和风险控制系统及做出必要的调整；对旗下基金重大投资的批准与授权等。

(2) 投资总监在公司有关规章制度授权范围内，对重大投资进行审查批准；并且根据基金合同的有关规定，在组合业绩比较基准的基础上，制定各组合资产和行业配置的偏差度指标。

(3) 分析师根据宏观经济、货币财政政策、行业发展动向和上市公司基本面等进行分析，提出宏观策略意见、债券配置策略及行业配置意见。

(4) 定期不定期召开基金经理例会，基金经理们在充分听取各分析师意见的基础上，确公司对市场、资产和行业的投资观点，该投资观点是指导各基金进行资产和行业配置的依据。

(5) 基金经理在投资总监授权下，根据基金经理例会所确定的资产/行业配置策略以及偏差度指标，在充分听取策略分析师宏观配置意见、股票分析师行业配置意见及固定收益分析师的债券配置意见，进行投资组合的资产及行业配置；之后，在股票分析师设定的股票池内，根据所管理组合的风险收益特征和流动性特征，构建基金组合。

(6) 基金经理下达交易指令到交易室进行交易。

(7) 定量分析师负责对投资组合进行事前、事中、事后的风险评估与控制。

(8) 定量分析师负责完成内部基金业绩评估，并完成有关评价报告。

投资决策委员会有权根据市场变化和实际情况的需要，对上述投资管理程序做出调整。

## **(六) 业绩比较基准**

三年期银行定期存款(税前)加权平均收益率。

其理由：

1. 为投资者广为熟悉的存款利率；
2. 直观、极易为投资者了解；
3. 容易得到的收益定量指标；

由于定期存款利率存在变动，因此本基金选择三年期定期存款加权利率。

### **(七) 风险收益特征**

追求每年高于一定正回报的投资品种。属于适度风险、适中收益的混合型基金，其长期的预期收益和风险高于债券基金，低于股票基金。

### **(八) 投资禁止行为与限制**

#### **1. 组合限制**

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：

(1) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；

(2) 本基金与本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过该证券的 10%；

(3) 进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；

(4) 本基金股票、债券、现金和权证的投资比例；

(5) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(6) 保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

(7) 运用基金财产进行权证投资时，不得有下列情形：

i. 在任何交易日买入权证的总金额，超过上一交易日基金资产净值的千分之五。

ii. 持有的全部权证，其市值超过基金资产净值的百分之三。

iii. 本基金与基金管理人管理的其他基金持有同一权证的总和，超过该权证的百分之十。

(8) 法律法规和基金合同规定的其他限制。

(9) 法律法规或中国证监会对上述比例限制另有规定的，应从其规定。

法律法规或监管部门取消上述限制的，本基金不受上述限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述 (1)、(2)、(3)、(4)、(7) 项

规定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

## 2. 禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- (6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- (7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (8) 依照法律法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

3. 如果法律法规对本基金合同约定的投资禁止行为和投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。

## (九) 基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则

- 1、不谋求对所投资企业的控股或者进行直接管理；
- 2、所有参与均在合法合规的前提下维护基金投资人利益并谋求基金资产的保值和增值。

## (十) 基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人招商银行根据本基金合同规定，于 2009 年 12 月 24 日复核了本

报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2009 年 9 月 30 日（“报告期末”）。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	904,702,734.55	41.98
	其中：股票	904,702,734.55	41.98
2	固定收益投资	1,159,396,464.40	53.79
	其中：债券	1,159,396,464.40	53.79
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	63,558,896.64	2.95
6	其他资产	27,596,585.64	1.28
7	合计	2,155,254,681.23	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	10,199,692.80	0.48
B	采掘业	44,955,000.00	2.10
C	制造业	325,551,768.54	15.22
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	17,432,189.28	0.81
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	16,005,801.56	0.75
C4	石油、化学、塑胶、塑料	10,121,529.00	0.47
C5	电子	5,006,662.14	0.23

C6	金属、非金属	45,656,138.83	2.13
C7	机械、设备、仪表	93,329,640.18	4.36
C8	医药、生物制品	116,759,807.55	5.46
C99	其他制造业	21,240,000.00	0.99
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	40,638,512.62	1.90
F	交通运输、仓储业	21,745,778.77	1.02
G	信息技术业	99,259,410.13	4.64
H	批发和零售贸易	13,087,691.93	0.61
I	金融、保险业	197,724,274.50	9.24
J	房地产业	46,015,788.06	2.15
K	社会服务业	24,978,143.60	1.17
L	传播与文化产业	7,068,000.00	0.33
M	综合类	73,478,673.60	3.43
	合计	904,702,734.55	42.29

## 3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600415	小商品城	1,699,916	67,316,673.60	3.15
2	600583	海油工程	4,500,000	44,955,000.00	2.10
3	000063	中兴通讯	1,050,000	40,089,000.00	1.87
4	601398	工商银行	7,000,000	33,390,000.00	1.56
5	601166	兴业银行	944,194	31,904,315.26	1.49
6	601009	南京银行	1,799,941	31,750,959.24	1.48
7	601318	中国平安	600,000	30,420,000.00	1.42
8	601169	北京银行	1,500,000	25,845,000.00	1.21
9	600765	中航重机	2,000,000	24,340,000.00	1.14
10	600648	外高桥	1,299,882	22,331,972.76	1.04

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	273,497,000.00	12.78
2	央行票据	99,670,000.00	4.66
3	金融债券	353,420,000.00	16.52
	其中：政策性金融债	302,130,000.00	14.12
4	企业债券	223,874,528.40	10.46
5	企业短期融资券	208,460,000.00	9.74
6	可转债	474,936.00	0.02
7	其他	-	-
8	合计	1,159,396,464.40	54.19

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	070420	07 农发 20	3,000,000	302,130,000.00	14.12
2	0981028	09 鲁高速 CP01	1,100,000	110,550,000.00	5.17
3	010110	21 国债(10)	1,000,000	102,760,000.00	4.80
4	0901035	09 央票 35	1,000,000	99,670,000.00	4.66
5	0981078	09 晋煤 CP01	1,000,000	97,910,000.00	4.58

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8、投资组合报告附注

(1) 报告期内本基金投资的中兴通讯（000063）于 2008 年 10 月 7 日发布《关

于财政部驻深圳市财政监察专员办事处 2007 年度会计信息质量检查结论和处理决定的公告》，中兴通讯因其 2007 年度会计信息质量问题被处以行政罚款金额计人民币 16 万元整并补缴企业所得税人民币 380 万元。

对该股票投资决策程序的说明：该股票根据股票池审批流程后进入本基金备选库，根据核心股票池审批流程后进入本基金管理人核心股票池，由研究员定期跟踪并分析。《关于财政部驻深圳市财政监察专员办事处 2007 年度会计信息质量检查结论和处理决定的公告》公布后，本基金管理人对该上市公司进行了进一步了解和进一步分析，认为此事项对上市公司财务状况、经营成果和现金流量未产生重大的实质性影响，因此，没有改变本基金管理人对该上市公司的投资判断。

其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

(2) 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,620,781.64
2	应收证券清算款	19,372,238.28
3	应收股利	-
4	应收利息	6,560,456.70
5	应收申购款	43,109.02
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	27,596,585.64

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600583	海油工程	44,955,000.00	2.10	非公开发行
2	600765	中航重机	24,340,000.00	1.14	非公开发行

## 第十二节 基金的业绩

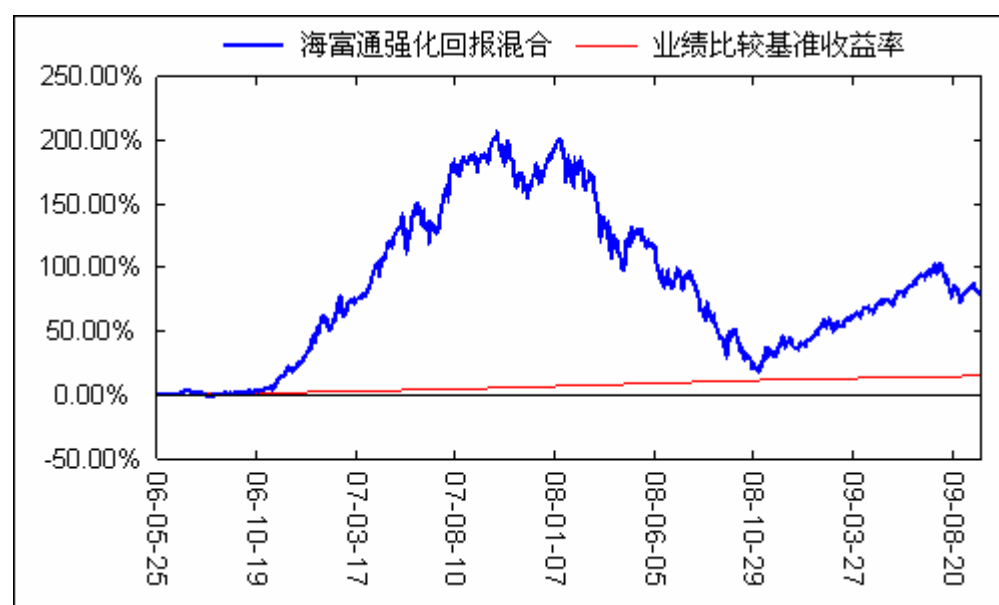
基金业绩截止日为2009年9月30日。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

(一) 本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表:

阶段	净值增长率(1)	净值增长率标准差(2)	业绩比较基准收益率(3)	业绩比较基准标准差(4)	(1) - (3)	(2) - (4)
2006.5.25(基金合同生效日)-2006.12.31	34.36%	0.68%	2.10%	0.01%	32.26%	0.67%
2007.1.1-2007.12.31	112.73%	1.78%	4.49%	0.01%	108.24%	1.77%
2008.1.1-2008.12.31	-52.27%	2.20%	5.17%	0.01%	-57.44%	2.19%
2009.1.1-2009.6.30	38.22%	0.97%	1.64%	0.01%	36.58%	0.96%
2009.1.1-2009.9.30	32.02%	1.10%	2.48%	0.01%	29.54%	1.09%
2006.5.25(基金合同生效日)-2009.9.30	80.12%	1.67%	14.98%	0.01%	65.14%	1.66%

(二) 本基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图:



注：1、按照本基金合同规定，本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月。建仓期满至今，本基金投资组合均达到本基金合同第十二条（二）、（七）规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。

### 第十三节 基金的财产

#### （一）基金资产总值

本基金基金资产总值包括基金所拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金的应收款项和其他资产的价值总和。

#### （二）基金资产净值

本基金基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

#### （三）基金财产的账户

本基金财产以基金名义开立银行存款账户，以基金托管人的名义开立证券交易清算资金的结算备付金账户，以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户，以本基金的名义开立银行间债券托管账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

#### （四）基金财产的保管及处分

1、本基金财产独立于基金管理人及基金托管人的固有财产，并由基金托管人保管。

2、基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得

的财产和收益，归基金财产。

3、基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算范围。

4、除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定处分外，基金财产不得被处分。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 第十四节 基金资产的估值

### （一）估值目的

基金估值的目的是为了准确、真实地反映基金相关金融资产和金融负债的公允价值。开放式基金份额申购、赎回价格应按基金估值后确定的基金份额净值计算。

### （二）估值日

本基金合同生效后，每个交易日对基金财产进行估值。

### （三）估值方法

#### 1. 股票估值方法：

(1) 上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

#### (2) 未上市股票的估值：

1) 首次发行未上市的股票，按成本计量；

2) 送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价估值；

3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价估值；

4) 非公开发行有明确锁定期的流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值；

(3) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1) - (2)小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认

为按本项第(1) - (2)小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；

(4) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

## 2. 债券估值方法：

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，按最近交易日的收盘价估值；

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的应收利息(自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息)得到的净价进行估值，估值日没有交易的，以最近交易日的收盘净价估值；

(3) 发行未上市债券采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

(4) 在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值；

(5) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值；

(6) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1) - (5)小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第(1) - (5)小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；

(7) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

## 3. 权证估值方法：

(1) 基金持有的权证，从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值；估值日没有交易的，按最近交易日的收盘价估值；

未上市交易的权证采用估值技术确定公允价值；在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

(2) 在任何情况下,基金管理人如采用本项第(1)小项规定的方法对基金资产进行估值,均应被认为采用了适当的估值方法。但是,如果基金管理人认为按本项第(1)小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况,并与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值;

(3) 国家有最新规定的,按其规定进行估值。

4. 如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时,应立即通知对方,共同查明原因,双方协商解决。

5. 根据有关法律法规,基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任,因此,就与本基金有关的会计问题,如经相关各方在平等基础上充分讨论后,仍无法达成一致的意见,按照基金管理人对外公布的结果予以公布。

#### (四) 估值对象

基金所持有的金融资产和金融负债。

#### (五) 估值程序

1. 基金份额净值是按照每个开放日闭市后,基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算,精确到0.001元,小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的,从其规定。

每工作日计算基金资产净值及基金份额净值,并按规定公告。

2. 基金管理人应每个工作日对基金资产估值。基金管理人每个开放日对基金资产估值后,将基金份额净值结果发送基金托管人,经基金托管人复核无误后,由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

#### (六) 估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后三位以内(含第三位)发生差错时,视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应以下约定处理:

## 1. 差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记结算机构、或代销机构、或投资人自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

## 2. 差错处理原则

(1) 差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的，由差错责任方承担赔偿责任；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。

(2) 差错的责任方对可能导致有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

(3) 因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方。

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿；追偿过程中产生的有关费用，应列入基金费用，从基金资产中支付。

(6) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、基金合同或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失。

(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

### 3. 差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

(3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据差错处理的方法，需要修改基金登记结算机构交易数据的，由基金登记结算机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认。

### 4. 基金份额净值差错处理的原则和方法如下：

(1) 基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

(2) 错误偏差达到基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告。

(3) 因基金份额净值计算错误，给基金或基金份额持有人造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

(4) 基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾

差，以基金管理人计算结果为准。

(5) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

(七) 暂停估值的情形

1. 基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
2. 因不可抗力或其它情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
3. 如出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的；
4. 中国证监会认定的其它情形。

(八) 用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金份额净值并以加密传真等方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后以双方确认的方式传送给基金管理人，由基金管理人对外公布。

(九) 特殊情况的处理

1. 基金管理人或基金托管人按股票估值方法的第(3)项、债券估值方法的第(6)项或权证估值方法的第(2)项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。
2. 由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 第十五节 基金的收益与分配

### (一) 基金收益的构成

1. 买卖证券差价；
2. 基金投资所得红利、股息、债券利息；

3. 银行存款利息；
4. 已实现的其他合法收入。

因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。

## **(二) 基金净收益**

基金净收益为基金收益扣除按照国家有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

## **(三) 收益分配原则**

本基金收益分配应遵循下列原则：

1. 本基金的每份基金份额享有同等分配权；
2. 基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值；
3. 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按分红登记日经除息后的基金份额净值自动转为基金份额。
4. 每实现收益达到一年定期存款(税前)利率，即可分红。在满足分红的条件下每年分红不超过12次，每次分配比例不低于基金已实现收益的60%；
5. 基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式（指将现金红利按分红登记日经除息后的基金份额净值为计算基准自动转为基金份额），基金份额持有人可选择现金方式或红利再投资方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；投资者可以在不同销售机构对本基金设置为相同的分红方式，亦可设置为不同的分红方式，即同一基金账户对本基金在各销售机构设置的分红方式相互独立、互不影响。
6. 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

## **(四) 收益分配方案的确定与公告**

基金收益分配方案中应载明基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人核实后确定，基金管理人应在二日内公告，并在公开披露日报中国证监会备案。

## **(五) 基金收益分配中发生的费用**

1、收益分配采用红利再投资方式的，免收再投资的费用；采用现金红利方式，则可从分红现金中提取一定的数额或者比例用于支付注册登记手续费，如收取该项费用，具体提取标准和方法在相关公告中规定。

2、收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担；如果基金份额持有人所获现金红利不足支付前述银行转账等手续费用，或者现金红利低于基金管理人规定的数额的，注册登记人可自动将该基金份额持有人的现金红利按权益登记日经除息后的基金份额净值为计算基准转为基金份额。

## 第十六节 基金的费用和税收

### （一）基金费用的种类

1. 基金管理人的管理费；
2. 基金托管人的托管费；
3. 基金财产拨划支付的银行费用；
4. 基金合同生效后的信息披露费用；
5. 基金份额持有人大会费用；
6. 基金合同生效后的会计师费和律师费；
7. 基金的证券交易费用；
8. 按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内按照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

### （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}, \text{ 本基金年管理费率为 } 1.50\%$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理

费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

## 2、基金托管人的基金托管费

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下:

$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ , 本基金年托管费率为 0.25%

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

3、上述(一)中3到8项费用由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定,按费用支出金额支付,列入或摊入当期基金费用。

### (三) 不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付,基金收取认购费的,可以从认购费中列支。

### (四) 基金管理费、基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费、基金托管费,无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前三个工作日在至少一种指定媒体上刊登公告。

### (五) 税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定,履行纳税义务。

## 第十七节 基金的会计与审计

### (一) 基金会计政策

1. 基金管理人为本基金的会计责任方;

2. 本基金的会计年度为公历每年的1月1日至12月31日,如果基金首次募集的会计年度,基金合同生效少于2个月,可以并入下一个会计年度;
3. 本基金的会计核算以人民币为记账本位币,以人民币元为记账单位;
4. 会计制度执行国家有关的会计制度;
5. 本基金独立建账、独立核算;
6. 基金管理人保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算,按照有关规定编制基金会计报表;
7. 基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并书面确认。

## (二) 基金年度审计

1. 基金管理人聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。
2. 会计师事务所更换经办注册会计师时,应事先征得基金管理人和基金托管人同意,并报中国证监会备案。
3. 基金管理人(或基金托管人)认为有充足理由更换会计师事务所,经基金托管人(或基金管理人)同意,并报中国证监会备案后可以更换。基金管理人应当在更换会计师事务所后在2日内公告。

## 第十八节 基金的信息披露

基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定。基金管理人、基金托管人应按规定将基金信息披露事项在规定时间内通过中国证监会指定的全国性报刊和基金管理人、基金托管人的互联网网站等媒介披露。公开披露的基金信息包括:

### (一) 招募说明书

招募说明书是基金向社会公开发售时对基金情况进行说明的法律文件。

基金管理人按照《基金法》、《信息披露办法》、基金合同编制并在基金份额发售的3日前,将基金招募说明书登载在指定报刊和网站上。基金合同生效后,

基金管理人应当在每 6 个月结束之日起 45 日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新的招募说明书摘要登载在指定报刊上。基金管理人将在公告的 15 日前向中国证监会报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。

#### (二) 基金合同、托管协议

基金管理人应在基金份额发售的 3 日前，将基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应将基金合同、托管协议登载在各自网站上。

#### (三) 基金份额发售公告

基金管理人将按照《基金法》、《信息披露办法》的有关规定，就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和网站上。

#### (四) 基金合同生效公告

基金管理人将在基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。基金合同生效公告中将说明基金募集情况。

#### (五) 基金份额上市交易公告书

基金份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易 3 个工作日前，将基金份额上市交易公告书登载在指定报刊和网站上。

#### (六) 基金资产净值公告、基金份额净值公告、基金份额累计净值公告

1. 本基金的基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人将至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值；

2. 基金管理人将在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值；

3. 基金管理人将公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。

#### (七) 基金份额申购、赎回价格公告

基金管理人应当在本基金的基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资人能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

#### (八) 基金年度报告、基金半年度报告、基金季度报告

1. 基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并

将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告需经具有从事证券相关业务资格的会计师事务所审计后，方可披露；

2. 基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定报刊上；

3. 基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定报刊和网站上。

#### (九) 临时报告与公告

在基金运作过程中发生如下可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的事件时，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案：

1. 基金份额持有人大会的召开；
2. 终止基金合同；
3. 转换基金运作方式；
4. 更换基金管理人、基金托管人；
5. 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
6. 基金管理人股东及其出资比例发生变更；
7. 基金募集期延长；
8. 基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
9. 基金管理人的董事在一年内变更超过 50%；
10. 基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过 30%；
11. 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；
12. 基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
13. 基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；
14. 重大关联交易事项；

15. 基金收益分配事项;
16. 管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更;
17. 基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%;
18. 基金改聘会计师事务所;
19. 变更基金份额发售机构;
20. 基金更换注册登记机构;
21. 本基金开始办理申购、赎回;
22. 本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更;
23. 本基金发生巨额赎回并延期支付;
24. 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请;
25. 本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回;
26. 中国证监会规定的其他事项。

(十) 澄清公告

在本基金合同存续期限内,任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的,相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清,并将有关情况立即报告中国证监会。

(十一) 基金份额持有人大会决议

(十二) 中国证监会规定的其他信息

(十三) 信息披露文件的存放与查阅

基金合同、托管协议、招募说明书或更新后的招募说明书、年度报告、半年度报告、季度报告和基金份额净值公告等文本文件在编制完成后,将存放于基金管理人所在地、基金托管人所在地、有关销售机构及其网点,供公众查阅。投资人在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

投资人也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。本基金的信息披露事项将在至少一种指定媒体上公告。

本基金的信息披露将严格按照法律法规和基金合同的规定进行。

## 第十九节 风险揭示

### （一）市场风险

基金主要投资于证券市场，而证券市场价格因受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而产生波动，从而导致基金收益水平发生变化，产生风险。主要的风险因素包括：

1、政策风险。因财政政策、货币政策、产业政策、地区发展政策等国家宏观政策发生变化，导致市场价格波动，影响基金收益而产生风险。

2、经济周期风险。随着经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化，基金投资的收益水平也会随之变化，从而产生风险。

3、利率风险。金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于债券和股票，其收益水平可能会受到利率变化的影响。

4、上市公司经营风险。上市公司的经营状况受多种因素的影响，如管理能力、行业竞争、市场前景、技术更新、财务状况、新产品研究开发等都会导致公司盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。上市公司还可能出现难以预见的变化。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全避免。

5、购买力风险。基金投资的目的是基金资产的保值增值，如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响基金资产的保值增值。

### （二）信用风险

基金在交易过程中可能发生交收违约或者所投资债券的发行人违约、拒绝支付到期本息等情况，从而导致基金资产损失。

### （三）管理风险

基金管理人的专业技能、研究能力及投资管理水平直接影响到其对信息的占有、分析和对经济形势、证券价格走势的判断，进而影响基金的投资收益水平。同时，基金管理人的投资管理制度、风险管理和内部控制制度是否健全，能否有效防范道德风险和其他合规性风险，以及基金管理人的职业道德水平等，也会对

基金的风险收益水平造成影响。

#### **（四）流动性风险**

我国证券市场作为新兴转轨市场，市场整体流动性风险较高。基金投资组合中的股票和债券会因各种原因面临较高的流动性风险，使证券交易的执行难度提高，买入成本或变现成本增加。此外，基金投资人的赎回需求可能造成基金仓位调整和资产变现困难，加剧流动性风险。

为了克服流动性风险，本基金将在坚持分散化投资和精选个股原则的基础上，通过一系列风险控制指标加强对流动性风险的跟踪、防范和控制，但基金管理人并不保证完全避免此类风险。

#### **（五）操作和技术风险**

基金的相关当事人在各业务环节的操作过程中，可能因内部控制不到位或者人为因素造成操作失误或违反操作规程而引致风险，如越权交易、内幕交易、交易错误和欺诈等。

此外，在开放式基金的后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行甚至导致基金持有人利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、基金托管人、注册登记人、销售机构、证券交易所和证券登记结算机构等。

#### **（六）合规性风险**

指基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规或基金合同有关规定的风险。

#### **（七）特有风险**

在基金管理运作过程中基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能或采用的模型等，会影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。因此，本基金的收益水平与本基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能或采用的模型等相关性较大。因此本基金可能因为基金管理人的因素而影响基金收益水平。

#### **（八）其他风险**

1、因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、风险管理和内控制度等方面不完善而产生的风险；

2、因金融市场危机、行业竞争压力可能产生的风险；

3、战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，可能严重影响证券市场运行，导致基金资产损失；

4、其他意外导致的风险。

## 第二十章 基金的终止和清算

### （一）基金的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

- (1) 基金份额持有人大会决定终止的；
- (2) 基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在 6 个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；
- (3) 基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在 6 个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；
- (4) 基金合并、撤销；
- (5) 《基金合同》约定的其他情形；
- (6) 中国证监会允许的其他情况。

### （二）基金的清算

#### 1. 基金财产清算小组

(1) 基金合同终止时，成立基金清算小组，基金清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2) 基金清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。

(3) 基金清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金清算小组可以依法进行必要的民事活动。

#### 2. 基金财产清算程序

基金合同终止后，发布基金清算公告；

- (1) 基金合同终止时，由基金清算小组统一接管基金财产；
- (2) 对基金财产进行清理和确认；

- (3) 对基金财产进行估价和变现;
- (4) 聘请律师事务所出具法律意见书;
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计;
- (6) 将基金清算结果报告中国证监会并公告;
- (7) 参加与基金财产有关的民事诉讼;
- (8) 公布基金清算公告;
- (9) 对基金剩余财产进行分配。

### 3. 清算费用

清算费用是指基金清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用,清算费用由基金清算小组优先从基金财产中支付。

### 4. 基金财产按下列顺序清偿:

- (1) 支付清算费用;
- (2) 交纳所欠税款;
- (3) 清偿基金债务;
- (4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1) - (3)项规定清偿前,不分配给基金份额持有人。

### 5. 基金财产清算的公告

清算小组成立后2日内应就清算小组的成立进行公告;清算过程中的有关重大事项须及时公告;基金清算报告由基金财产清算小组报中国证监会备案后3日内公告。

### 6. 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

## 第二十一节 基金合同的内容摘要

### (一) 基金份额持有人权利与义务

#### 1.1 基金份额持有人的权利

1. 分享基金财产收益;

2. 参与分配清算后的剩余基金财产;
3. 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额;
4. 按照规定要求召开基金份额持有人大会;
5. 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会,对基金份额持有人大会审议事项行使表决权;
6. 查阅或者复制公开披露的基金信息资料;
7. 监督基金管理人的投资运作;
8. 对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼;
9. 法律法规和基金合同规定的其他权利。

每份基金份额具有同等的合法权益。

## **1.2 基金份额持有人的义务**

1. 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定;
2. 交纳基金认购、申购款项及规定的费用;
3. 在持有的基金份额范围内,承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任;
4. 不从事任何有损基金、其他基金份额持有人及其他基金当事人合法权益的活动;
5. 执行生效的基金份额持有人大会决议;
6. 返还在基金交易过程中因任何原因,自基金管理人、基金托管人及基金管理人的代理人处获得的不当得利;
7. 法律法规和基金合同规定的其他义务。

## **(二) 基金管理人的权利与义务**

### **2.1 基金管理人的权利**

1. 依法募集基金,办理基金备案手续;
2. 自本基金合同生效之日起,依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产;
3. 根据法律法规和基金合同的规定决定本基金的相关费率结构和收费方式,获得基金管理费,收取认购费、申购费、基金赎回手续费及其它事先批准或公告的合理费用以及法律法规规定的其它费用;

4. 根据法律法规和基金合同之规定销售基金份额；
5. 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
6. 在符合有关法律法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、基金转换、非交易过户、转托管、受益分配等业务的规则；
7. 根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会和银行业监督管理机构，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；
8. 在法律法规规定、基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；
9. 自行担任基金注册登记机构或选择、更换基金注册登记机构，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；
10. 依据基金合同的规定选择、更换基金代销机构，并依据销售代理协议和有关法律法规，对基金代销的行为进行必要的监督和检查；
11. 依据法律法规和基金合同的规定，决定基金收益分配方案；
12. 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
13. 依法召集基金份额持有人大会；
14. 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
15. 法律法规和基金合同规定的其他权利。

## **2.2 基金管理人的义务**

1. 依法募集基金，办理或者委托其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
2. 办理基金备案手续；
3. 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；
4. 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产，配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购和

赎回业务或委托其他机构代理该项业务；

5. 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

6. 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得以基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

7. 接受基金托管人依法进行的监督；

8. 按照法律法规及其它有关规定计算并公告基金份额净值，确定基金份额申购、赎回价格；

9. 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回、注销和转换价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；

10. 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

11. 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

12. 编制中期和年度基金报告；

13. 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

14. 不谋求对上市公司的控股和直接管理；

15. 保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

16. 按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

17. 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

18. 执行生效的基金份额持有人大会决议；

19. 按规定保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

20. 确保需要向基金份额持有人提供的各项文件或资料，在规定时间内发出；保证投资人能够按照基金合同约定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并得到有关资料的复印件；

21. 不从事任何有损基金财产及本基金其他当事人利益的活动;
22. 以基金管理人名义, 代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;
23. 组织并参加基金财产清算小组, 参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;
24. 因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益, 应当承担赔偿责任, 其赔偿责任不因其退任而免除;
25. 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时, 应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;
26. 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时, 及时报告中国证监会并通知基金托管人;
27. 法律法规和基金合同规定的其他义务。

### **(三) 基金托管人的权利与义务**

#### **3.1 基金托管人的权利**

1. 依据法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产;
2. 依据基金合同的约定获得基金托管费;
3. 在基金管理人更换时, 提名新任基金管理人;
4. 根据本基金合同及有关规定监督基金管理人, 对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为, 对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形, 应及时呈报中国证监会, 并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益;
5. 依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会;
6. 法律法规和基金合同规定的其他权利。

#### **3.2 基金托管人的义务**

1. 以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金财产;
2. 设立专门的基金托管部, 具有符合要求的营业场所, 配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员, 负责基金财产托管事宜;
3. 建立健全内部控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度, 确保基金财产的安全, 保证其托管的基金财产与基金托管人自有资产以及不同的基金财产相互独立; 对不同的基金分别设置账户, 独立核算, 分账管理, 保证不同基金

之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

4. 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得以基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

5. 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

6. 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；

7. 保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

8. 对基金财务会计报告、中期和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

9. 按照规定保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

10. 按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

11. 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

12. 复核、审查基金管理人计算的基金份额净值和基金份额申购、赎回价格；

13. 按照规定监督基金管理人的投资运作；

14. 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

15. 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

16. 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；

17. 执行生效的基金份额持有人大会决议；

18. 参加基金财产清算组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

19. 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；

20. 因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

21. 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；

22. 不从事任何有损基金及基金其他当事人利益的活动;
23. 法律法规和基金合同规定的其他义务。

#### **(四) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则**

基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人合法的授权代表共同组成。

##### **A. 召开事由**

1. 当出现或需要决定下列事由之一时，应当召开基金份额持有人大会：
  - (1) 终止基金合同；
  - (2) 转换基金运作方式；
  - (3) 变更基金类别；
  - (4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略；
  - (5) 变更基金份额持有人大会程序；
  - (6) 更换基金管理人、基金托管人；
  - (7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
  - (8) 本基金与其他基金的合并；
  - (9) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。
2. 出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同，不需召开基金份额持有人大会：
  - (1) 调低基金管理费、基金托管费、其他应由基金承担的费用；
  - (2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、赎回费率或收费方式；
  - (3) 因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；
  - (4) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；
  - (5) 基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
  - (6) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

##### **B. 召集方式**

1. 除法律法规或本基金合同另有约定外,基金份额持有人大会由基金管理人召集,开会时间、地点、方式和权益登记日由基金管理人选择确定。基金管理人未按规定召集或者不能召集时,由基金托管人召集。

2. 基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集,并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起 60 日内召开;基金管理人决定不召集,基金托管人仍认为有必要召开的,应当自行召集并确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

3. 代表基金份额 10%以上(含 10%,以下均同)的基金份额持有人(该比例以提出提议之时提请人所持有的基金份额与基金总份额之比例计算,下同)认为有必要召开基金份额持有人大会的,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集,并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起 60 日内召开;基金管理人决定不召集,代表基金份额 10%以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的,应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集,并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人;基金托管人决定召集的,应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

4. 代表基金份额 10%以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会,而基金管理人、基金托管人都不召集的,代表基金份额 10%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会,但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

5. 基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的,基金管理人、基金托管人应当配合,不得阻碍、干扰。

### C. 通知

1. 基金份额持有人大会的召集人(以下简称“召集人”)负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会,召集人必须于会议召开日前 30 天在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容:

(1) 会议召开的时间、地点和出席方式;

- (2) 会议拟审议的主要事项;
- (3) 会议形式;
- (4) 议事程序;
- (5) 有权出席基金份额持有人大会的权益登记日;
- (6) 授权委托书的内容要求(包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等)、送达时间和地点;
- (7) 表决方式;
- (8) 会务常设联系人姓名、电话;
- (9) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续;
- (10) 召集人需要通知的其他事项。

2. 采用通讯方式开会并进行表决的情况下,由召集人决定通讯方式和书面表决方式,并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表达意见的寄交和收取方式、投票表决的截止日及表决票的送达地址等内容。

3. 如召集人为基金管理人,还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督;如召集人为基金托管人,则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督;如召集人为基金份额持有人,则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。

#### **D. 会议的召开方式**

##### **1. 会议方式**

- (1) 基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。
- (2) 现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席,现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席。
- (3) 通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。
- (4) 会议的召开方式由召集人确定,但决定转换基金运作方式、基金管理人更换或基金托管人的更换、终止基金合同的事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

2. 召开基金份额持有人大会的条件

(1) 现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

1) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%）；

2) 到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符。

未能满足上述条件的情况下，则召集人可另行确定并公告重新开会的时间（至少应提前 25 个工作日）和地点，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

(2) 通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

1) 召集人按本基金合同规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

2) 召集人在基金托管人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见；

3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%）；

4) 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的其他代表，同时提交的持有基金份额的凭证符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与登记注册机构记录相符；

5) 会议通知公布前报中国证监会备案。

如果开会条件达不到上述的条件，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间（至少应提前 25 个工作日），且确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊

不清或相互矛盾的视为弃权表决,但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

## **E. 议事内容与程序**

### **1. 议事内容及提案权**

(1) 议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的事项以及召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

(2) 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 10% 以上(含 10%) 的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案;也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案,临时提案应当在大会召开日前 40 天提交召集人。召集人对于临时提案应当在大会召开日前 30 天公告。

(3) 对于基金份额持有人提交的提案(包括临时提案),大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核:

关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系,并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的,应提交大会审议;对于不符合上述要求的,不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决,应当在该次基金份额持有人大会上解释和说明。

程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题作出决定。如将其提案进行分拆或合并表决,需征得原提案人同意;原提案人不同意变更的,大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会作出决定,并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

(4) 单独或合并持有权利登记日基金总份额 10% 以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案、基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案,未获基金份额持有人大会审议通过,就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议,其时间间隔应不少于 6 个月。

(5) 基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后,如果需要对原有提案进行修改,应当最迟在基金份额持有人大会召开日前 30 日公告。否则,会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

## 2. 议事程序

### (1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项，确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，形成大会决议。

大会由基金管理人授权代表主持。在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额 50% 以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名(或单位名称)、身份证号码、住所地址、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名(或单位名称)等事项。

### (2) 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人提前 30 天公布提案，在所通知的表决截止日期第 2 天在公证机构监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。

3. 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## F. 表决

1. 基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

2. 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

### (1) 一般决议

一般决议须经出席会议的基金份额持有人及其代理人所持表决权的 50% 以上通过方为有效，除下列(2)所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过；

### (2) 特别决议

特别决议须经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方为有效；涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同等重大事项必须以特别决议通过方为有效。

3. 基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准，或者备案，并予以公告。

4. 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

5. 基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

## **G. 计票**

### **1. 现场开会**

(1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举 3 名基金份额持有人担任监票人。

(2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点，由大会主持人当场公布计票结果。

(3) 如会议主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对投票数进行重新清点；如会议主持人未进行重新清点，而出席会议的基金份额持有人或代理人对会议主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，会议主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

### **2. 通讯方式开会**

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

## **H. 生效与公告**

1. 基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

2. 生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决定。

3. 基金份额持有人大会决议应自生效之日起 3 日内在至少一种指定媒体公

告。

### **(五) 基金合同解除和终止的事由、程序**

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

- (1) 基金份额持有人大会决定终止的；
- (2) 基金管理人职责终止，在六个月内没有新基金管理人承接的；
- (3) 基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金托管人承接的；
- (4) 法律法规和基金合同规定的其他情形。

#### **2) 基金清算程序：**

##### **1. 基金财产清算小组**

(1) 基金合同终止时，成立基金清算小组，基金清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2) 基金清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。

(3) 基金清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金清算小组可以依法进行必要的民事活动。

##### **2. 基金财产清算程序**

基金合同终止后，发布基金清算公告；

- (1) 基金合同终止时，由基金清算小组统一接管基金财产；
- (2) 对基金财产进行清理和确认；
- (3) 对基金财产进行估价和变现；
- (4) 基金清算组作出清算报告
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- (6) 聘请律师事务所出具法律意见书；
- (7) 将基金清算结果报告中国证监会；
- (8) 公布基金清算公告；
- (9) 对基金剩余财产进行分配。

##### **3. 清算费用**

清算费用是指基金清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清

算费用由基金清算小组优先从基金财产中支付。

4. 基金财产按下列顺序清偿：

- (1) 支付清算费用；
- (2) 交纳所欠税款；
- (3) 清偿基金债务；
- (4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1) - (3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

5. 基金财产清算的公告

清算小组成立后 2 日内应就清算小组的成立进行公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金清算报告由基金财产清算小组报中国证监会备案后 3 日内公告。

6. 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

#### **(六) 争议解决方式**

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会上海分会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的金融争议仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本基金合同受中国法律管辖。

#### **(七) 基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式**

基金合同存放在基金管理人、基金托管人和销售机构的办公场所和营业场所，在办公时间内可供免费查阅。投资人也可以直接登录基金管理人的网站 [www.hftfund.com](http://www.hftfund.com) 进行查阅。投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。对投资人按此种方式所获得的文件及其复印件，基金管理人和基金托管人应保证与所公告的内容完全一致。

## 第二十二节 基金托管协议的内容摘要

### (一) 托管协议当事人

#### 1.1 基金管理人

名称：海富通基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36-37 层

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36-37 层

法定代表人：邵国有

成立时间：2003 年 4 月 18 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[2003]48 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.5 亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：发起设立基金，基金管理业务，中国证监会允许的其他业务

#### 1.2 基金托管人

名称：招商银行股份有限公司

住所：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：秦晓

成立日期：1987 年 4 月 8 日

批准设立机关及批准设立文号：银复[1986]175 号

注册资本：人民币 147.07 亿元

组织形式：股份有限公司

存续期间：持续经营

经营范围：人民币存款、贷款、结算业务；居民储蓄业务；信托贷款、投资业务；金融租赁业务；外汇存款；外汇汇款；外汇投资；在境内、外发行或代理发行外币有价证券；贸易、非贸易结算；外币票据贴现；外汇放款；买卖或代理买卖外汇及外币有价证券；境内、外外汇借款；外汇及外币票据兑换；外汇担保；保管箱业务；征信调查、咨询服务；基金托管业务。代办开放式基金的认购、

申购、赎回业务；受托投资管理托管业务及经中国银监会和中国人民银行批准的其他业务。

## **(二) 基金托管人与基金管理人之间的业务监督、核查**

### **2.1 基金托管人对基金管理人的业务监督和核查**

根据《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关证券法律法规的规定，基金托管人的监督内容包括但不限于：基金的投资范围、基金投融资比例、基金资产估值、基金资产净值计算与会计核算、基金管理人报酬的计提和支付、基金费用的支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金申购资金的到账和赎回资金的划付、基金收益分配、基金的融资等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

#### **A. 基金托管人对基金投资范围及投资对象进行监督和核查**

1、本基金的投资范围：国内依法发行上市的股票、债券、货币市场金融工具及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

2、基金托管人应建立相关技术系统，对基金的投资范围和投资对象是否符合基金合同的规定进行监督。对基金管理人发送的不符合基金合同规定的投资指令，基金托管人可以拒绝执行，并书面通知基金管理人；对于已经执行的投资指令，基金托管人发现该投资行为不符合基金合同规定的，基金托管人应书面通知基金管理人进行调整，如基金管理人不能及时调整，基金托管人应将该情况报告中国证监会。

#### **B. 基金托管人对基金投融资比例进行监督和核查**

1、本基金的组合限制：

(1) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；

(2) 本基金与本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过该证券的 10%；

(3) 进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；

(4) 本基金股票、债券、现金和权证的投资比例；

(5) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产

产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司当次发行股票的总量；

(6) 保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

(7) 运用基金财产进行权证投资时，不得有下列情形：

i. 在任何交易日买入权证的总金额，超过上一交易日基金资产净值的千分之五。

ii. 持有的全部权证，其市值超过基金资产净值的百分之三。

iii. 本基金与基金管理人管理的其他基金持有同一权证的总和，超过该权证的百分之十。

(8) 法律法规和基金合同规定的其他限制。

(9) 法律法规或中国证监会对上述比例限制另有规定的，应从其规定。

法律法规或监管部门取消上述限制的，本基金不受上述限制。

2、基金托管人应对基金的投资和融资比例是否符合基金合同的规定进行监督。基金托管人应自基金合同规定的投资建仓期满起，监督基金合同约定的基金投资资产配置比例、单一投资类别比例限制、融资限制、股票申购限制、基金投资比例是否符合法规规定，基金托管人发现基金管理人违反法律法规规定或基金合同约定的投融资比例限制，基金托管人应书面通知基金管理人进行限期纠正，限期应符合法规允许的投资比例调整期限。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述(1) - (4)、(7)项规定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。基金管理人在规定的限期内未能纠正的，基金托管人应书面报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

### **C. 基金托管人对基金投资禁止行为的监督和核查**

1、本基金的投资禁止行为

(1) 承销证券；

(2) 向他人贷款或者提供担保；

(3) 从事承担无限责任的投资；

(4) 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；

(5) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

(6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；

(7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

(8) 依照法律法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

上述约定内容，如相关法律法规、规章另有明确规定使得此部分内容不符或冲突的，基金管理人、基金托管人应当对此进行修改并遵照执行。

2、基金托管人应对基金的投资禁止行为进行监督。对基金管理人发送的属于投资禁止的投资指令，基金托管人可以拒绝执行，并书面通知基金管理人；对于已经执行的投资指令，基金托管人发现该投资行为属于投资禁止行为的，基金托管人应书面通知基金管理人进行调整，如基金管理人不能及时调整，基金托管人应将该情况报告中国证监会。

3、为配合对关联投资限制实施监督所采取的措施。基金管理人和基金托管人应在基金合同生效前以及关联方发生变化时，相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单。

D. 为控制基金参与银行间债券市场的信用风险，基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。

基金管理人应在基金运作之前向基金托管人提供慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手列表或更改对手列表的通知，基金管理人应严格按照交易对手列表的范围在银行间交易市场选择交易对手。基金托管人按照交易对手列表监督基金在银行间的交易行为。基金管理人发送的银行间交易指令不符合交易对手列表的，基金托管人可以拒绝执行，并书面通知基金管理人。基金管理人可

以每半年对银行间债券市场交易对手名单更新,如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单,应向托管人说明理由,在与交易对手交易前3个工作日内与基金托管人协商解决。基金管理人负责对交易对手的资信控制,按银行间债券市场的交易规则进行交易,基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。

E. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金管理人选择存款银行进行监督。

为保证基金资产的安全性和流动性,活期存款存放在基金托管人处。

基金管理人应按年向基金托管人提供存款银行列表,基金托管人按照基金管理人提供的存款银行的列表办理定期存款、通知存款和协议存款等存款投资业务。基金管理人需与存款银行签订合作协议,约定各项权利和义务,并将基金存款存放在存款银行指定的分支机构。

基金托管人根据存款银行列表对基金投资银行存款的交易对手是否符合有关规定进行监督。对于不符合规定的银行存款,基金托管人可以拒绝执行,并书面通知基金管理人。

基金投资存款需遵守法律法规和基金合同的约定,法律法规或基金合同未允许投资定期存款、通知存款等之前,基金不得投资于此类存款。

以上约定与法律法规的规定不符,则按现行有效法律法规执行。

F. 基金托管人根据《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关证券法律法规的规定对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用支付及收入确定、基金申购资金的到账和赎回资金的划付、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息,应向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

G. 基金托管人发现基金管理人关于基金投资范围、投融资组合比例等内容违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、本托管协议、上述监督内容的约定和

其他有关法律法规的规定，应及时以书面形式通知基金管理人在规定时间内纠正，基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在规定时间内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人的投资指令违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律、法规规定的行为，可以拒绝执行，通知基金管理人，并向中国证监会报告。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的划款指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时以书面形式通知基金管理人在规定时间内纠正。

如基金托管人认为基金管理人的作为或不作为违反了法律法规、基金合同或本托管协议，基金托管人应呈报中国证监会和其他监管部门，有权利并有义务行使法律法规、基金合同或本托管协议赋予、规定的基金托管人的所有权利和救济措施，以保护基金财产的安全和基金投资者的利益，包括但不限于就更换基金管理人事宜召集基金份额持有人大会、代表基金对因基金管理人的过错造成的基金资产的损失向基金管理人索赔。

H. 基金管理人义务配合和协助基金托管人依照托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或就基金托管人的疑义进行解释或举证；对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度。基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据托管协议的规定行使核查权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金托管人进行有效核查，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人在此情形下，有权召集基金份额持有人大会，提请更换基金管理人、代表基金对因基金管理人的过错造成基金资产的损失向基金管理人索赔。

## 2.2 基金管理人 对基金托管人的业务核查

A. 根据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定，基金管理人 对基金托管人及时执行基金管理人合法合规的投资指令、根据基金管理人指令办 理清算交收、安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基 金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、相关信息披露和监督基金投资运 作等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

B. 基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分 账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息 等行为违反《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定，应及时以书面 形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式 给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。

基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时 通知基金托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

C. 基金托管人有义务配合和协助基金管理人依照托管协议对基金业务执 行监督、核查。对基金管理人发出的书面提示，基金托管人提交相关资料以供基 金管理人核查托管财产的完整性和真实性，并在规定时间内答复基金管理人并改 正。基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠基金管理人根据本托管协议的规定行使 核查权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金管理人进行有效核查，情节严重或经 基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。基金管理人在 此情形下，有权召集基金份额持有人大会，提请更换基金托管人、代表基金对因 基金托管人的过错造成的基金财产的损失向基金托管人索赔。

## （三）基金财产的保管

### 3.1 基金资产保管的原则

1、基金财产的保管责任，由基金托管人承担。基金托管人应遵守《基金法》、 基金合同、本托管协议及其他有关规定，为基金份额持有人的最大利益安全保管

基金财产。基金托管人保证恪尽职守，依照诚实信用、勤勉尽责的原则，谨慎、有效的持有并保管基金财产。

2、基金财产独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。基金托管人应按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。基金托管人对所托管的不同基金的财产分别设置账户、实行严格的分账管理，确保基金财产的完整与独立。基金托管人应安全、完整地保管基金财产，未经基金管理人的正当指令，基金托管人不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。

3、对于基金申购过程中产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日没有到达基金托管人处的基金申购款项，基金托管人应及时通知基金管理人，由基金管理人采取措施进行催收，由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿。

4、对于因为基金投资产生的应收资产，由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金托管人处的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行处理，由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿。

5、基金托管人应当设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；建立健全内部风险监控制度，对负责基金财产托管的部门和人员的行为进行事先控制和事后监督，防范和减少风险。

### **3.2 基金募集期满时募集资金的验证**

1、基金募集期间的资金应存于基金管理人在基金托管行人的营业机构开立的“基金募集专户”专用账户，任何人不得动用。

2、基金募集期届满，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，由基金管理人在十日内聘请具有从事证券业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的2名以上（含2名）中国注册会计师签名有效。基金管理人应将募集的属于基金财产的全部资金存入基金托管人以基金名义开立的银行账户中。基金托管人在收到资金当日出具基金财产接收报告。

3、若基金募集期限届满，未能达到基金合同生效的条件，由基金管理人按基金合同规定办理退款事宜。

### **3.3 基金银行账户的开立和管理**

1、基金的银行账户的开立和管理由基金托管人根据基金管理人的申请办理。基金管理人予以配合并提供相关资料。基金托管人要确保所托管基金全部存款的安全。

2、基金托管人根据基金管理人的指令办理资金支付。本基金的预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，均需通过基金的银行账户进行。

3、本基金银行账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

4、基金银行账户的开立和管理应符合银行业法律法规的有关规定。

### **3.4 基金证券交收账户、资金交收账户的开立和管理**

1、基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司和深圳分公司为基金开立托管人与本基金联名的证券账户，用于本基金证券投资的清算和存管。

2、基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户，亦不得使用基金的任何证券账户进行本基金业务以外的活动。

3、基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，管理和运用由基金管理人负责。

4、基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司和深圳分公司开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。

### **3.5 债券托管账户的开立和管理**

1、基金合同生效后，由基金管理人向中国证监会、中国人民银行申请基金进入全国银行间同业拆借市场进行交易。基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定，在中央国债登记结算有限责任公司开立债

券托管与结算账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算，基金管理人予以配合并提供相关资料。

2、基金管理人和基金托管人应一起负责为基金对外签订全国银行间债券市场回购主协议，基金托管人保管协议正本，基金管理人保存协议副本。

### **3.6 基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证的保管**

实物证券可以存放于基金托管人的保管库，也可存入中央国债登记结算有限责任公司或中国证券登记结算有限责任公司。保管凭证由基金托管人保存。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。托管人对由托管人以外机构实际有效控制的证券不承担责任。银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人保存。

### **3.7 与基金资产有关的重大合同的保管**

1、与基金财产有关的重大合同的签署，由基金管理人负责。由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别由基金托管人、基金管理人保管。基金管理人和基金托管人应在合同签署后及时以加密方式将合同传真给对方，并在五个工作日内将正本送达对方相关责任人处。除协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。如上述合同只有一份正本且该正本先由基金管理人取得，则基金管理人应及时将正本送达基金托管人处。保管期限按照国家有关规定执行。

2、因基金管理人将自己保管的本基金重大合同在未经基金托管人同意的情况下，用于抵押、质押、担保或债权转让或作其他权利处分而造成基金资产损失，由基金管理人负责，基金托管人予以免责。

3、因基金托管人将自己保管的本基金重大合同在未经基金管理人同意的情况下，用于抵押、质押、担保或债权转让或作其他权利处分而造成基金资产损失，由基金托管人负责，基金管理人予以免责。

## **(四) 基金资产净值计算与复核**

### **4.1 基金资产净值的计算和复核**

#### **1、基金资产净值**

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的余额。

## 2、复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后，将估值结果加盖业务公章以书面形式发送给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核；经基金托管人复核无误后，加盖业务公章并以加密传真方式传送给基金管理人，由基金管理人对外公布。

3、根据相关法规，开放式基金的基金会计责任方由基金管理人担任。因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，基金管理人有权按照其对基金资产净值的计算结果对外予以公布，并承担由此而产生的责任。基金托管人有权将该等情况报相关监管机构备案。

4、如基金管理人和基金托管人对基金资产净值、基金份额净值的计算结果有差异，且双方在平等基础上充分讨论后仍无法达成一致的意见，则基金管理人有权按其计算结果对外予以公告，并承担由此而产生的责任。基金托管人有权将该等情况报相关监管机构备案。

## 4.2 基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

## 4.3 基金账册的建立和核对

基金托管人和基金管理人在基金合同生效后，应按照基金合同中约定的记账法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本基金的全套账册，对双方各自的账册定期进行核对，互相监督，切实保证基金财产的安全。

基金管理人按日编制基金估值表，与基金托管人核对。基金管理人与基金托管人对基金账册每月核对一次。经对账发现双方的账目存在不符的，基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正，保证双方平行登录的账册记录完全相符。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金资产净值及基金收益情况的计算和公告的，以基金管理人的账册为准，并由基金管理人承担由此而产生的责任（但基金管理人无过错除外）。

## 4.4 基金财务报表与报告的编制和复核

### 1、财务报表的编制

基金财务报表由基金管理人和基金托管人按规定分别独立编制。

## 2、报表复核

基金托管人在收到基金管理人编制的基金财务报表后，进行独立的复核。核对不符时，应及时通知基金管理人共同查出原因，进行调整，直至双方数据完全一致。核对无误后，在核对过的基金财务报表上加盖基金托管人和基金管理人公章，各留存一份。

## 3、财务报表的编制与复核时间安排

(1) 月度报表的编制，应于每月结束后 5 个工作日内完成。基金管理人应在每月结束之日起 3 个工作日内完成在月度报表编制，加盖公章后，将有关报表提供基金托管人复核；基金托管人应在收到之日起 2 个工作日内完成复核，核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖公章，双方各自留存一份。

(2) 基金季度报告在截止日后 15 个工作日内公告。基金管理人应在每季度结束之日起 10 个工作日内完成在季度报表编制，加盖公章后，将有关报表提供基金托管人复核；基金托管人应在收到之日起 5 个工作日内完成复核，核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖公章，双方各自留存一份。

(3) 基金合同生效后，基金管理人应当在每六个月结束之日起 45 日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定报刊上。基金管理人应当在基金合同生效后，每六个月结束之日起 20 日内完成招募说明书（更新）的编制，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 10 日内进行复核，核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖公章，双方各自留存一份。

(4) 半年度报告在基金会计年度前六个月结束后 60 日内公告。基金管理人应在上半年结束之日起 30 日内完成半年度报告的编制，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在确认收到之日起 10 日内完成复核，核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖公章，双方各自留存一份。

(5) 年度报告在基金会计年度结束后 90 日内公告。基金管理人在每年结束之日起 50 日内完成年度报告的编制，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在确认收到之日起 15 日内完成复核，核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖公章，双方各自留存一份。

基金托管人在对季度报告、半年度报告、年度报告复核完毕后，需出具相应的复核确认书，以备有权机构对相关文件审核时提示。

4、基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准；若双方无法达成一致，以基金管理人的帐务处理为准，并承担由此而产生的责任。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表、文件达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，并由基金管理人承担相关责任，基金托管人有权就相关情况报中国证监会备案。

5、在基金的存续期内，如果中国证监会就基金财务报表与报告的编制规则及编制内容颁布新的法律法规，基金管理人、基金托管人应依照届时有效的法律法规，互相配合、互相监督，进行编制和披露。

#### **（五）基金份额持有人名册的保管**

（1）基金托管人负责基金份额持有人名册的保管。

（2）基金管理人应在十个工作日内采用电子数据表格的方式向基金托管人提供基金合同生效日、持有人大会登记日和基金清算登记日的持有人名册，持有人名册的内容包括但不限于持有人的名称和持有的基金份额。

（3）基金托管人应妥善保管基金管理人提供的名册，不得将所保存的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。基金托管人对基金份额持有人名册的保管，按国家法律法规及证券监督管理部门的要求执行。

基金管理人和基金托管人应保存基金份额持有人名册 15 年。

基金托管人无法妥善保管基金管理人所提供的基金持有人名册或将持有人名册用于基金托管业务以外的，应承担由此引起的对持有人直接利益损失的责任。

#### **（六）争议解决方式**

本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

双方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，应先友好协商解决。协商不成，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会上海分会根据该会届时有效的金融争议仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局性的。

争议处理期间，双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，各自继续

忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

### **（七）托管协议的修改与终止**

（1）本协议经双方当事人协商一致，可以进行修改。修改后的新协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。修改后的新协议，报中国证监会核准后生效。

（2）发生以下情况，本托管协议终止：

- 1、基金或基金合同终止；
- 2、基金托管人依法解散、被依法撤销、被依法宣告破产或由其他基金托管人接管基金财产；
- 3、基金管理人依法解散、被依法撤销、被依法宣告破产或由其他基金管理人接管其基金管理权；
- 4、发生《基金法》、基金合同或其他法律法规规定的终止事项。

## **第二十三章 对基金份额持有人的服务**

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

### **（一）资料寄送服务**

#### **1. 帐户确认书**

根据客户的需要，为客户寄送开放式基金帐户确认书。如客户需要开放式基金帐户的主帐户卡，根据中国证券登记结算公司的业务规则到它指定的券商营业网点打印。

#### **2. 对账单**

基金投资人对账单包括季度对账单与年度对账单。

季度对账单在每季结束后的 15 个工作日内向有交易的持有人寄送，年度对账单在每年度结束后 15 个工作日内对所有持有人寄送。

对帐单的寄送方式分为邮寄和电子邮件两种方式。如客户需要重置寄送方式或寄送频率，请致电本公司客服中心或登陆公司网站。

### 3. 其他相关的信息资料

介绍公司最新动态、投资运作、新产品、国内外金融市场动态和投资机会等。

#### **(二) 基金间转换服务**

投资人可在基金管理人管理的不同开放式基金间转换基金份额，并享受基金间的转换费率。

#### **(三) 定期投资计划**

在技术条件成熟时，基金管理人将利用直销网点或代销网点为投资人提供定期投资的服务。通过定期投资计划，投资人可以通过固定的渠道，定期申购基金份额。该定期投资计划的有关规则另行公告。

#### **(四) 网络在线服务**

通过基金公司网站的留言板和客服信箱，客户可以实现在线咨询、投诉、建议和寻求各种帮助。

网站提供了基金公告、投资资讯、理财刊物、基金常识等各种信息，投资人可以根据各自的使用习惯非常方便的自行查询或信息定制。

我们为现有投资人提供了基金帐户查询、交易明细查询、对帐单寄送方式或频率设置、修改查询密码等服务。

公司网址：<http://www.hftfund.com>

电子信箱：[info@hftfund.com](mailto:info@hftfund.com)

#### **(五) 信息定制服务**

在技术条件成熟时，基金管理人还可为基金客户提供通过基金管理公司网站、客户服务中心提交信息定制申请，基金管理公司通过手机短讯、E-MAIL定期为客户发送所定制的信息，内容包括：每笔交易确认查询、每月账户余额与损益查询、最近季度的基金投资组合、分红提示、公司最新公告、新产品信息披露、基金净值查询等。

#### **(六) 客户服务中心 (CALL-CENTER) 电话服务**

呼叫中心自动语音系统提供 7×24 小时交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息查询，在正常交易时间提供针对直销客户的电话委托下单服务。

呼叫中心人工座席每个交易日上午 9:00-11:30，下午 13:00-17:30 为投资人提供服务，投资人可以通过该热线获得业务咨询，信息查询，服务投诉，

信息定制，资料修改等专项服务。

每个周五下午 15:30 - 17:30, 基金经理或投资顾问定期通过呼叫中心与投资人进行交流, 就投资人关心的基金投资运作情况、市场走势、宏观经济等问题进行解答。

客服电话: 40088-40099 (免长途话费)

传真: 021-50479997

### (七) 投诉受理

投资人可以拨打海富通基金管理有限公司客户服务中心电话或以书信、电子邮件等方式, 对基金公司和销售网点提所提供的服务进行投诉。

对于工作日期间受理的投诉, 原则上是及时回复, 对于不能及时回复的投诉, 我们承诺在两个工作日之内对您的投诉做出回复。对于非工作日提出的投诉, 我们将在顺延的工作日当日进行回复。

### (八) 网上开户与交易服务

2005年10月28日, 海富通基金管理有限公司与银联电子支付服务有限公司合作正式推出网上交易平台, 为投资者提供方便快捷的网上在线开户交易服务, 中国银联客户可以通过海富通基金网站实现网上开户和交易。(包括认购、申购、赎回等)。

目前, 对持有建设银行龙卡、兴业银行兴业卡、浦发银行东方卡、中信银行卡、农业银行金穗卡或其他银联通网上交易支持的银行卡的投资者通过本公司网上交易系统认购、申购本公司旗下开放式基金实行费率优惠, 具体优惠政策如下:

1、对于持有建设银行龙卡的投资者:

(1) 对于持有建设银行龙卡的投资者申购费率标准如下:

基金名称	申购金额 (M) (单位: 元)	优惠费率
海富通精选混合	M < 50 万	1.2%
海富通股票	50 万 ≤ M < 100 万	0.96%
海富通收益增长混合	100 万 ≤ M < 200 万	0.8%
海富通强化回报混合	200 万 ≤ M < 500 万	0.6%
海富通风格优势股票	M ≥ 500 万	按笔收取, 1000 元/笔
海富通中国海外股票 (QDII)		
海富通领先成长股票		
海富通精选贰号混合	M < 100 万	1.6%

	100 万 ≤ M < 500 万	1.28%
	500 万 ≤ M < 1000 万	0.8%
	M ≥ 1000 万	按笔收取, 1000 元/笔
海富通稳健添利债券 A	M < 100 万	0.64%
	100 万 ≤ M < 200 万	0.5%
	200 万 ≤ M < 500 万	0.3%
	M ≥ 500 万	按笔收取, 1000 元/笔

(2) 投资者通过本公司网上交易平台申请将其持有的海富通货币基金份额 (A 级基金代码: 519505, B 级基金代码: 519506) 转换为海富通精选混合、海富通收益增长混合、海富通股票、海富通强化回报混合、海富通风格优势股票、海富通精选贰号混合和海富通领先成长股票基金的, 转换费统一按上述 1 (1) 中列示的标准收取。

2、对于持有农业银行金穗卡的个人投资者:

(1) 对于持有农业银行金穗卡的投资者申购费率标准如下:

基金名称	申购金额 (M) (单位: 元)	优惠费率
海富通精选混合 海富通股票 海富通收益增长混合 海富通强化回报混合 海富通风格优势股票 海富通中国海外股票 (QDII) 海富通领先成长股票	M < 50 万	1.05%
	50 万 ≤ M < 100 万	0.84%
	100 万 ≤ M < 200 万	0.7%
	200 万 ≤ M < 500 万	0.6%
	M ≥ 500 万	按笔收取, 1000 元/笔
	海富通精选贰号混合	M < 100 万
	100 万 ≤ M < 500 万	1.12%
	500 万 ≤ M < 1000 万	0.6%
	M ≥ 1000 万	按笔收取, 1000 元/笔
海富通稳健添利债券 A	M < 100 万	0.6%
	100 万 ≤ M < 200 万	0.5%
	200 万 ≤ M < 500 万	0.3%
	M ≥ 500 万	按笔收取, 1000 元/笔

(2)投资者通过本公司网上交易平台申请将其持有的海富通货币基金份额(A级基金代码:519505,B级基金代码:519506)转换为海富通精选混合、海富通收益混合、海富通股票、海富通强化回报混合、海富通风格优势股票、海富通精选贰号混合和海富通领先成长股票基金的,转换费统一按上述2(1)中列示的标准收取。

3、对于持有兴业银行兴业卡、浦发银行东方卡、中信银行中信卡或其他银联网上交易支持的银行卡的投资者:

(1)申购费率标准如下:

基金名称	申购金额(M)(单位:元)	优惠费率
海富通精选混合 海富通股票 海富通收益增长混合 海富通强化回报混合 海富通风格优势股票 海富通中国海外股票(QDII) 海富通领先成长股票	M < 500 万	0.6%
	M ≥ 500 万	按笔收取,1000元/笔
海富通精选贰号混合	M < 1000 万	0.6%
	M ≥ 1000 万	按笔收取,1000元/笔
海富通稳健添利债券 A	M < 100 万	0.6%
	100 万 ≤ M < 200 万	0.5%
	200 万 ≤ M < 500 万	0.3%
	M ≥ 500 万	按笔收取,1000元/笔

(2)投资者通过本公司网上交易平台申请将其持有的海富通货币基金份额转换为海富通精选混合、海富通收益增长混合、海富通股票、海富通强化回报混合、海富通风格优势股票、海富通精选贰号混合和海富通领先成长股票基金份额的,转换费统一按上述3(1)中列示的标准收取。

## 第二十四节 其他披露事项

### （一）基金注册登记人

#### 1. 委托与更换程序

基金管理人委托中国证监会认定的机构办理本基金的注册登记业务。基金管理人委托上述机构办理登记业务，应与其签订委托代理协议，以明确基金管理人与其在投资人基金账户管理、基金份额登记过户、基金清算和交收、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等事宜中的权利和义务，保护基金投资人和基金份额持有人的合法权益。

注册登记人的更换程序：

（1）提名：由基金管理人提名。

（2）核准：新任注册登记人报中国证监会审查资格并核准后，原任注册登记人方可退任；

（3）公告：基金注册登记人更换，由基金管理人在更换前 30 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上公告。

（4）交接：原基金注册登记人应做出处理基金注册登记事务的报告，并与新任基金注册登记人完成业务移交手续，向新任基金注册登记人提交完整的书面材料和电子数据；新任基金注册登记人与基金管理人核对全部基金份额持有人账户资料，确保准确无误；在业务移交后，原基金注册登记人仍有义务保留本基金正式移交日之前的注册登记业务的全部资料和电子数据一年，并有义务在该期限内协助新任基金注册登记人处理有关问题，保障基金份额持有人的合法权益；如因原基金注册登记人业务移交产生的问题，原基金注册登记人仍有协助解决之义务。

**2. 基金管理人现时委托中国证券登记结算有限责任公司办理本基金的注册登记业务。**

#### 3. 基金注册登记人概况

基金注册登记人：中国证券登记结算有限责任公司

法定代表人：陈耀先

注册资本：6 亿元

注册地址：北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

组织形式：有限责任公司

营业期限：长期

中国证券登记结算有限责任公司是经国务院同意、中国证券监督管理委员会批准，在国家工商行政管理局注册登记的中国唯一的证券登记结算机构。由上海证券交易所、深圳证券交易所共同出资组建，公司设在北京。

公司实行董事会领导下的总经理负责制，设有 5 个部门和 2 个分公司，分别是综合管理部、登记托管部、结算部、技术部、业务发展部、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司。

中国证券监督管理委员会是公司主管部门，公司业务接受中国证券监督管理委员会的监管。

公司经营范围：

- (1) 证券账户和结算账户的设立和管理；
- (2) 证券登记与过户；
- (3) 证券托管与转托管；
- (4) 证券和资金的清算与交收；
- (5) 受发行人委托办理证券权益分配等代理人服务；
- (6) 中国证券监督管理委员会批准的其他业务。

## (二) 本期刊登的公告

- 1、 2009 年 6 月 30 日，本基金管理人刊登了《关于旗下部分基金在上海浦东发展银行开展网上银行基金申购费率优惠活动的公告》。
- 2、 2009 年 7 月 1 日，本基金管理人刊登了《海富通基金管理有限公司旗下开放式基金 2009 年半年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值公告》。
- 3、 2009 年 7 月 17 日，本基金管理人刊登了《海富通强化回报混合型证券投资基金 2009 年第二季度报告》。
- 4、 2009 年 7 月 23 日，本基金管理人刊登了《关于海富通旗下部分开放式基金在国元证券股份有限公司开通基金转换业务的公告》。
- 5、 2009 年 7 月 30 日，本基金管理人刊登了《关于海富通旗下基金增加中国民族证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告》。

- 6、 2009年7月30日,本基金管理人刊登了《关于海富通旗下基金增加华宝证券经纪有限责任公司为开放式基金代销机构的公告》。
- 7、 2009年8月8日,本基金管理人刊登了《海富通基金管理有限公司关于旗下基金申购光大证券的公告》。
- 8、 2009年8月10日,本基金管理人刊登了《关于海富通旗下基金增加中国国际金融有限公司为开放式基金代销机构的公告》。
- 9、 2009年8月13日,本基金管理人刊登了《关于海富通旗下基金增加中国建银投资证券有限公司为开放式基金代销机构的公告》。
- 10、 2009年8月21日,本基金管理人刊登了《关于海富通旗下基金增加安信证券股份有限公司为开放式基金代销机构的公告》。
- 11、 2009年8月26日,本基金管理人刊登了《关于海富通旗下部分基金参加国信证券股份有限公司定期定额业务推广活动的公告》。
- 12、 2009年8月27日,本基金管理人刊登了《关于旗下部分基金新增宁波银行股份有限公司为代销机构的公告》。
- 13、 2009年8月27日,本基金管理人刊登了《关于海富通旗下基金增加湘财证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告》。
- 14、 2009年8月28日,本基金管理人刊登了《海富通强化回报混合型基金2009年度半年报》。
- 15、 2009年9月1日,本基金管理人刊登了《关于海富通旗下基金增加信达证券股份有限公司为开放式基金代销机构的公告》。
- 16、 2009年9月3日,本基金管理人刊登了《关于海富通旗下基金增加第一创业证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告》。
- 17、 2009年9月9日,本基金管理人刊登了《关于旗下基金在齐鲁证券有限公司开展网上交易费率优惠活动的公告》。
- 18、 2009年10月14日,本基金管理人刊登了《关于海富通旗下基金增加长城证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告》。
- 19、 2009年10月22日,本基金管理人刊登了《关于海富通旗下基金增加方正证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告》。
- 20、 2009年10月28日,本基金管理人刊登了《海富通强化回报基金2009

年第三季度报告》。

- 21、 2009年11月25日，本基金管理人刊登了《关于旗下部分基金在中国建银投资证券有限责任公司开展网上交易费率优惠活动的公告》。

## 第二十五节 基金管理人和基金托管人的更换

### （一）基金管理人和基金托管人的更换条件

1、有下列情形之一的，经中国证监会核准，基金管理人职责终止：

- （1）基金管理人被依法取消基金管理资格；
- （2）基金管理人依法解散、依法被撤销或被依法宣告破产；
- （3）基金管理人被基金份额持有人大会解任；
- （4）法律法规规定的其他情形。

2、有下列情形之一的，经中国证监会核准，基金托管人职责终止：

- （1）基金托管人被依法取消基金托管资格；
- （2）基金托管人依法解散、依法被撤销或被依法宣告破产；
- （3）基金托管人被基金份额持有人大会解任；
- （4）法律法规规定的其他情形。

### （二）基金管理人和基金托管人的更换程序

#### 1、基金管理人的更换程序

（1）提名：新任基金管理人由基金托管人或者单独或合计持有基金总份额10%以上（含10%）的基金份额持有人提名；

（2）决议：基金份额持有人大会在基金管理人职责终止后6个月内对被提名的新任基金管理人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的2/3以上（含2/3）表决通过；

（3）临时基金管理人：新任基金管理人产生之前，由中国证监会指定临时基金管理人；（4）核准：上述基金份额持有人大会决议自通过之日起五日内，由大会召集人报中国证监会核准；

（5）交接：基金管理人职责终止的，应当妥善保管基金管理业务资料，及时办理基金管理业务的移交手续，新任基金管理人或临时基金管理人应当及时接

收;

(6) 审计: 基金管理人职责终止的, 应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计, 并将审计结果予以公告, 同时报中国证监会备案; 审计费用在基金财产中列支; 若法律法规和监管机构对于会计师事务所的聘请权主体无相应规定, 则由基金管理人聘请会计师事务所对基金财产进行审计, 事前须报中国证监会备案;

(7) 公告: 基金管理人更换后, 由基金托管人于中国证监会核准后 2 日内至少在一种指定报刊上公告;

(8) 基金名称变更: 基金管理人退任后, 应原任基金管理人要求, 本基金应替换或删除基金名称中“海富通”的字样。

## 2、基金托管人的更换程序

(1) 提名: 新任基金托管人由基金管理人或者单独或合计持有基金总份额 10%以上(含 10%)的基金份额持有人提名;

(2) 决议: 基金份额持有人大会在基金托管人职责终止后 6 个月内对被提名的新任基金托管人形成决议; 该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的 2/3 以上(含 2/3) 表决通过;

(3) 新任基金托管人产生之前, 由中国证监会指定临时基金托管人;

(4) 核准: 上述基金份额持有人大会决议自通过之日起五日内, 由大会召集人报中国证监会核准;

(5) 交接: 基金托管人职责终止的, 应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料, 及时与新任基金托管人或临时基金托管人办理基金财产和托管业务移交手续, 新任基金托管人或临时基金托管人应当及时接收;

(6) 审计: 基金托管人职责终止的, 应当按照规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计, 并予以公告, 同时报中国证监会备案; 审计费用从基金财产中列支;

(7) 公告: 基金托管人更换后, 由基金管理人于中国证监会核准后 2 日内至少在一种指定报刊上公告。

## 第二十六节 招募说明书的存放及查阅方式

基金招募说明书、定期报告、临时报告与公告等文本存放在基金管理人、基金托管人和销售机构的办公场所和营业场所，在办公时间内可供免费查阅。投资人也可以直接登录基金管理人的网站 [www.hftfund.com](http://www.hftfund.com) 进行查阅。投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。对投资人按此种方式所获得的文件及其复印件，基金管理人和基金托管人应保证与所公告的内容完全一致。

## 第二十七节 备查文件

备查文件等文本存放在基金管理人、基金托管人和销售机构的办公场所和营业场所，在办公时间内可供免费查阅。

- (一) 中国证监会批准海富通强化回报混合型证券投资基金设立的文件
- (二) 《海富通强化回报混合型证券投资基金基金合同》
- (三) 《海富通强化回报混合型证券投资基金托管协议》
- (四) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- (五) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (六) 海富通基金管理有限公司募集海富通强化回报混合型证券投资基金的法律意见书
- (七) 《海富通基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- (八) 中国证监会要求的其他文件